

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年4月12日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	コア投資戦略ファンド（安定型） コア投資戦略ファンド（成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	コア投資戦略ファンド（安定型） 10兆円を上限とします。 コア投資戦略ファンド（成長型） 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

コア投資戦略ファンド（安定型）

コア投資戦略ファンド（成長型）

（以下、上記を総称して「コア投資戦略ファンド」又は「コアラップ」ということ、あるいは総称して又は個別に「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

愛称として、コア投資戦略ファンド（安定型）は「コアラップ（安定型）」、コア投資戦略ファンド（成長型）は「コアラップ（成長型）」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（ ）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方からの取得申込み及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）からの取得申込み（以下「確定拠出年金によるお申込み」といいます。）は、申込手数料を無料とします。

（ 6 ）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。また、確定拠出年金によるお申込みについては1円以上1円単位とします。

（ 7 ）【申込期間】

2022年 4月13日から2022年10月11日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（ 8 ）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ）【払込取扱場所】

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 1 2 ) 【その他】

### < 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

### < 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

### < 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

### < 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

### < スイッチング >

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。

< 受付不可日 > に該当する場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

### < 受付不可日 >

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

各ファンドにつき上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ( )		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	ファンド	(部分		
大型株	年2回			ヘッ	TOPIX	条件付運用型
中小型株			ファンド・	ジ)		
債券	年4回	日本	オブ・ファ		その他	ロング・
一般	年6回	北米	ンズ	なし	( )	ショート型/ 絶対収益追求 型
公債	(隔月)	欧州				
社債						
その他債券	年12回					その他
クレジット属	(毎月)	アジア				( )
性						
( )	日々	オセアニア				
不動産投信	その他	中南米				
	( )					
その他資産		アフリカ				
(投資信託証券						
(資産複合(株		中近東				
式、債券、不動		(中東)				
産投信、その他						
資産(バンク		エマージン				
ローン、デリバ		グ				
ティブ、為替予						
約取引等))資						
産配分変更						
型))						
資産複合						
( )						
資産配分						
固定型						
資産配分						
変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

##### [ 投資対象地域による区分 ]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

##### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

##### [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

##### [ 補足分類 ]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊

型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

###### (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

(1) 年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

(2) 年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3) 年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4) 年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5) 年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6) 日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

##### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]



- (1) グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2) 日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) 欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5) アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6) オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7) 中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8) アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9) 中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10) エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

- (1) ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2) ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

- (1) 為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2) 為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

- (1) 日経225
- (2) TOPIX
- (3) その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右さ

れにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

(4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

## 1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

## 2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
  - 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド<sup>\*1</sup>等に投資し、オルタナティブ運用<sup>\*2</sup>を行います。
- ※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
- ※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

## 3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。

従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

## 4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への 投資割合の合計 <sup>*3</sup>	運用の特徴
コア投資戦略ファンド(安定型) <sup>*4</sup> 愛称:コアラップ(安定型)	原則50%未満	安定性を重視
コア投資戦略ファンド(成長型) 愛称:コアラップ(成長型)	原則75%未満	安定性と収益性の バランスを重視

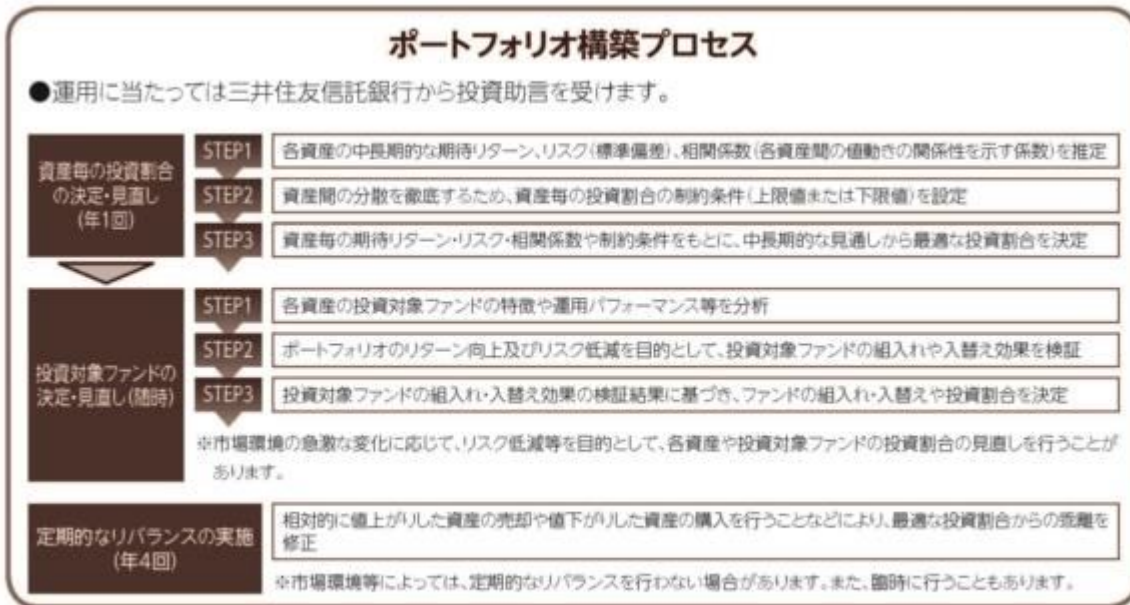
3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くな

る可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3 投資リスク

(1)ファンドのリスク ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

4「安定型」とは元本保証等を意味するものではなく、「成長型」と比較して安定的な運用を目指すファンドであることを意味しています。

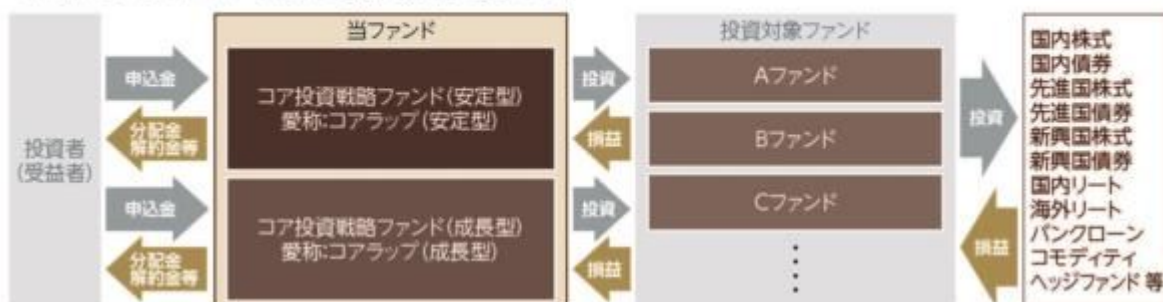
市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

#### ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針(2)投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。

## ？ ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券等に投資している複数の投資信託に投資して運用を行う仕組みです。

### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

- 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- 株式への直接投資は行いません。
- 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- デリバティブの直接利用は行いません。

### 〈ご参考情報〉

#### バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

#### コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

#### ヘッジファンド

ヘッジとは元々「回避する」という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド\*などがあります。

\*特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

2012年8月7日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年 1月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日： 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

### 投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）を主要投資対象とします。このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資する場合があります。

### 投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ<sup>\*1</sup>、ヘッジファンド<sup>\*2</sup>及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

\*1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

\*2：ヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的に金利、債券、株式、リート、為替、コモディティ等に対する裁定取引やデリバティブ取引等を積極的に活用するファンド、又は各種ヘッジファンド指数に概ね連動する投資成果を目標とするファンドを指します。

ロ．各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、以下の割合とします。

コア投資戦略ファンド（安定型）	コア投資戦略ファンド（成長型）
50%未満	75%未満

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

ニ．投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

ヘ．当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

ト．ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によって

は、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

### 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

### 金融商品の指図範囲

イ．委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

ロ．上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「（参考）投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

### （参考）投資対象ファンドの概要

- ・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2022年 1月31日（ ）のファンドに関しては2022年 3月17日、（ ）のファンドに関

しては2022年 4月12日）現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

なお、投資対象ファンドの運用会社より確認した情報をもとにしており、記載している定義は、当該ファンドに限定されます。

#### 1.国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場されている株式
投資態度	<p>原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>



主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX 総研又は株式会社JPX 総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPX が有しています。

JPX は、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

JPX は、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPX は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPX は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、JPX により提供、保証又は販売されるものではありません。

JPX は、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPX は、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPX は本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

## 2. 国内株式アクティブバリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いません。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いません。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行ないません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

### 3. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。</p> <p>信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。</p> <p>事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。</p> <p>投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。</p> <p>ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。</p> <p>市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜 0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

#### 4.FOFs用国内株式EVIバリュウファンド（適格機関投資家専用）（ ）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)（ ）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>日本の株式を主要投資対象とします。</li> <li>運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュウ指標（PBR、PER、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。</li> </ul> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数、配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、委託者が収益分配方針に従って分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜 0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数、配当込み）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

#### 5. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債
投資態度	<p>NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 6. 日本債券ツイン戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	<p>わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合（ ）を上回る投資成果を目指します。</p> <p>ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：2月21日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確



性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

#### 7.FOFs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資する「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。なお、日本を除く世界のインフレ連動国債等に直接投資することもあります。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>インフレ連動国債（物価連動国債）への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。</p> <p>このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：1月17日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年3月31日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として2017年3月31日から2027年1月18日</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

「ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス」とは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社が開発、算出、公表を行うインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスを表します。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。

Bloomberg<sup>(R)</sup> およびブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックスは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー、および同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめ

とする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。

#### 8. マニユライフF0Fs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	マニユライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニユライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 NOMURA-BPI総合（ ）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	債券への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。 有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

信託報酬	<p>毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとしします。</p> <table border="0"> <tr> <td>新発10年固定利付国債の利回り</td> <td>信託報酬</td> </tr> <tr> <td>0.5%未満の場合・・・</td> <td>純資産総額に対し、年率0.264% (税抜 0.24%)</td> </tr> <tr> <td>0.5%以上1%未満の場合・・・</td> <td>純資産総額に対し、年率0.297% (税抜 0.27%)</td> </tr> <tr> <td>1%以上の場合・・・</td> <td>純資産総額に対し、年率0.33% (税抜 0.3%)</td> </tr> </table>	新発10年固定利付国債の利回り	信託報酬	0.5%未満の場合・・・	純資産総額に対し、年率0.264% (税抜 0.24%)	0.5%以上1%未満の場合・・・	純資産総額に対し、年率0.297% (税抜 0.27%)	1%以上の場合・・・	純資産総額に対し、年率0.33% (税抜 0.3%)
新発10年固定利付国債の利回り	信託報酬								
0.5%未満の場合・・・	純資産総額に対し、年率0.264% (税抜 0.24%)								
0.5%以上1%未満の場合・・・	純資産総額に対し、年率0.297% (税抜 0.27%)								
1%以上の場合・・・	純資産総額に対し、年率0.33% (税抜 0.3%)								
信託財産留保額	該当事項はありません。								
設定日	2019年10月10日								
信託期間	原則として無期限								
受託会社	三井住友信託銀行株式会社								

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

#### 9. 明治安田F0Fs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	明治安田アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等に実質的に投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」ということがあります）受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等へ分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目指します。</p> <p>NOMURA-BPI総合（ ）をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。</p> <p>信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付会社によるBBB格相当以上の格付を有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると判断した公社債に投資します。</p> <p>債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。</p> <p>マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等を勘案して、デュレーションの調整、イールドカーブポジショニングのコントロールを行います。</p> <p>公社債の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月15日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>収益分配金にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.264%以内（税抜 0.24%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「NOMURA-BPI総合」は、日本国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

#### 10. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式

投資態度	<p>原則としてMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>
------	--

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）」とは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### 11. グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。



主要投資対象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
主な投資制限	株式の実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が投資信託財産の純資産総額を超えないものとし、
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は、委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。 収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%） マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとし、
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 12. ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンブルトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（ ）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 <マザーファンドの投資態度> 主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、見通しに基づいて米ドルを基準として相対的な魅力度を判断して、外国為替の予約取引等を通じて個別株式選択の結果とは異なる通貨配分とする場合があります。 資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年率0.671%（税抜 0.61%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2021年9月24日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、ドルベース）をもとに、委託者が独自に円換算したものです。MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc.に帰属します。MSCI Inc.では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	主として世界各国の金融商品取引所（これに準ずるものを含みます。）に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。 市場動向によっては、非上場株式及び債券等に投資を行う場合があります。 市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 原則として同一銘柄の転換社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 原則として同一銘柄の新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 純資産総額の10%を超えての借入れは、行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	年率0.525% その他の費用 ファンド管理費用：上限年率0.15% その他、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料及びデリバティブ取引に要する費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年11月7日
信託期間	無期限
関係法人	・ 管理会社 キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル ・ 投資顧問会社 キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー ・ 管理事務代行会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・ 名義書換事務受託会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・ 保管受託銀行 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）

## 14. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------

運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### 15. フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フィデリティ投信株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	フィデリティ・外国債券・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。

投資態度	<p>フィデリティ・外国債券・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、世界各国の投資適格債券（除く日本円）を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行ないます。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。</p> <p>資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものを除きます。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。</p> <p>分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行なうものではありません。</p> <p>留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.451%（税抜0.41%）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2021年7月16日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

#### 16. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
投資態度	<p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限



受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### 17. Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

運用会社	Wellington Management Company LLP
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	<p>金融商品取引所等に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。</p> <p>*この投資信託においては、新興国に所在する企業のほか、新興国に資産を保有している企業、新興国で生産された商品・サービスによる収入の割合が高い企業、新興国に対する商品・サービスの販売による収入の割合が高い企業等にも投資します。</p>
投資態度	<p>MSCIエマージング・マーケット・インデックス（ ）の騰落率を上回る投資成果を追求します。</p> <p>ポートフォリオは、カンントリー・アロケーションおよび業種別アナリストの個別銘柄選択による、ファンダメンタルズ分析に基づくボトム・アップ・アプローチで構築します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>運用会社が他に運用する投資信託の保有分を合算して、いずれか一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス
決算日	毎年12月31日
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	年率0.8%以内 なお、この報酬率には投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が含まれます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年5月30日
信託期間	原則として無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 管理会社（マネージメントカンパニー） Wellington Luxembourg S.a r.l.</li> <li>・ 運用会社（インベストメントマネージャー） Wellington Management Company LLP</li> <li>・ 預託機関（デポジタリー） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> <li>・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> <li>・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Bank International GMBH, Luxembourg Branch</li> </ul>

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### 18.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券

投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

#### 19. LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	当ファンドは、主に「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要投資対象	「LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 主に日本を除く世界の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（ ）をベンチマークとします。</p> <p>LM・ウエスタン・グローバル債券マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>&lt;マザーファンドの投資態度&gt;</p> <p>主に、日本を除く世界の公社債に投資します。</p> <p>ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）をベンチマークとします。</p> <p>原則として、取得時において1社以上の格付機関から投資適格（BBB - / Baa3）以上の長期格付けが付与された、あるいはこれに相当する信用力をもつと運用者が判断する公社債を主要な投資対象としますが、取得時において信託財産の20%を上限としてこれを下回る信用力の公社債に投資することがあります。</p> <p>外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、通貨見通しに基づいて相対的に魅力があると判断される通貨に、為替予約取引等を通じて資産配分することがあります。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用の指図に関する権限を下記投資顧問会社に委託します。</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー（在米国）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ（在ブラジル）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド（在シンガポール）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド（在オーストラリア）</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント株式会社</p>
------	---

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	毎年10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>* 分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.33%（税抜 0.3%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）」は、ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスをフランクリン・テンプレトン・ジャパン株式会社が独自に円換算したものです。Bloomberg<sup>(R)</sup> およびブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー、および同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。

## 20. J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券

投資態度	<p>わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「東証REIT指数（配当込み）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。

同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX 総研又は株式会社JPX 総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPX が有しています。

JPX は、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

JPX は、同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

JPX は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPX は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、JPX により提供、保証又は販売されるものではありません。

JPX は、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPX は、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、JPX は本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

## 21. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。 外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。



<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み）」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追隨するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にあ

る唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において当社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの新規設定または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

## 22. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券

投資態度	<p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）および「ブルームバーグ（Bloomberg<sup>(R)</sup>）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

### 23. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2022年1月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
投資態度	主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。 投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。 投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>L B M A金価格（円ヘッジベース）（ ）（2022年1月31日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年10月11日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

L B M A金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、L B M Aは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）は、L B M A金価格及びL B M A金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

#### 24. BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

<p>管理会社</p>	<p>BlueBay Funds Management Company S.A.</p>
<p>運用の基本方針</p>	<p>主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。</p>

主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 組入外貨建資産について対円で為替ヘッジを行うことがあります。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A.</li> <li>・投資顧問会社 BlueBay Asset Management LLP</li> <li>・副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc.</li> <li>・管理事務代行会社 / 名義書換事務受託会社 / 保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.</li> </ul>

## 25.FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「PTRディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>PTRディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 26. 米国株式LSマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。</p> <p>米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。</p> <p>米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>



主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 27. コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主としてブルームバーグ商品指数（ ）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」 1とといいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券 2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。</p> <p>2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値とします。</p>

投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（総称して、「ブルームバーグ」）とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）および「ブルームバーグ（Bloomberg<sup>(R)</sup>）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）およびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的で

の利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シーおよびその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグおよびUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性も保証するものではありません。

## 28. 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略<sup>1</sup>に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1) この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き<sup>2</sup>を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。</p> <p>2) 当該戦略の参照対象は、S&amp;P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含まれます。</p>
投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 29. ノムラF0Fs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。

## 投資態度

各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<日本成長株投資マザーファンドの投資態度>

わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。

ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度>

株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。

ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜 0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

## 30. ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）（ ）

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「LM・ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主要投資対象	<p>「LM・ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>&lt;マザーファンドの投資対象&gt;</p> <p>主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。</p>

投資態度	<p>L M・ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>L M・ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>&lt;マザーファンドの投資態度&gt;</p> <p>主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。</p> <p>モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。</p> <p>リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.418%（税抜 0.38%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p> <p>投資顧問会社の報酬は、委託者が收受する委託者報酬から支弁されます。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

## 31.MA Hedge Fund Strategies Limited

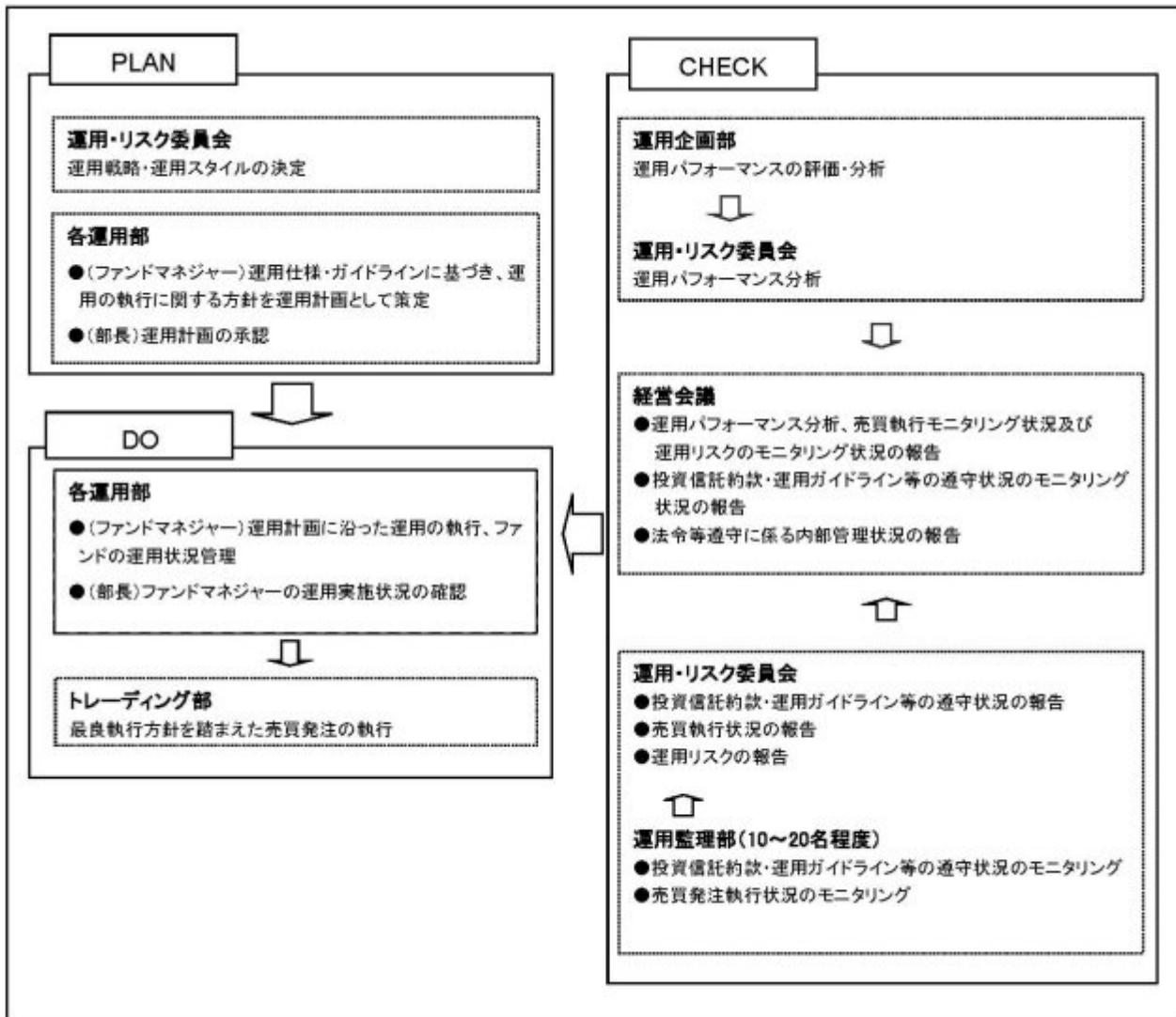
運用会社	UBS O'Connor LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
投資態度	公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 投資信託証券への投資は行いません。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日



関係法人	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 運用会社 UBS O'Connor LLC</li> <li>・ 保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited</li> </ul>
------	---

### （３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

#### （４）【配分方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

##### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

##### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

##### ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

##### ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

##### ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

##### ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

（ロ）上記（イ）の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

##### ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

##### チ．外国為替予約取引の指図

委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

##### リ．資金の借入れ

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- ヌ. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- < その他の投資制限 >
- イ. 当ファンドでは直接デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引及び選択権付債券売買を含みます。）は行いませんが、投資対象とする投資信託でデリバティブ取引等を行う場合、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

### 商品（コモディティ）の価格変動リスク

商品の価格は、需給関係や為替、金利変動等の様々な要因により大きく変動します。需給関係は、天候、作況、生産国（産出国）の政治、経済、社会情勢の変化等の影響を大きく受けます。商品価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

### 信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受け、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクがより高いものになると想定されます。

### 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。また、新興国への投資は先進国に比べ、上記のリスクが高まる可能性があります。

### 資産等の選定・配分に係るリスク

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資比率を変更します。この投資行動が、ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合があります。

また、投資対象とする資産やファンドの追加に伴い、新たな投資リスクが生じる可能性があります。

### ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的に現物有価証券、デリバティブや為替予約取引等の買建てや売建てによりポートフォリオを組成することがあり、買い建てている対象が下落した場合もしくは売り建てている対象が上昇した場合に損失が発生し、ファンドの基準価額に影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。また、投資対象ファンドの純資産総額を上回る買建て、売建てを行う場合があるため、投資対象ファンドの基準価額は現物有価証券に投資する場合と比べ大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

ヘッジファンドのパフォーマンスは、通常、運用者の運用能力に大きく依存することになるため、市場の動向に関わらず、損失が発生する可能性があります。

### 仕組み債券に係るリスク

投資対象ファンドにおいては、特定の対象（指数やファンド等）の値動きに概ね連動する投資成果を目指す仕組み債券を活用する場合がありますが、投資対象ファンドが、特定の対象と連動することを保証するものではありません。

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

なお、仕組み債券の発行体は少数であることが多いため、信用リスクが顕在化した場合には、投資対象ファンドは多数の発行体に分散投資を行う投資信託と比較して、大きな影響を被る可能性があります。また、発行体の財務状況や信用力の他、市場や経済環境の変動等により、仕組み債券が発行されない場合には、投資対象ファンドが償還となる可能性があります。

#### ブローカーの信用リスク

投資対象ファンドにおいては、直接もしくは実質的にデリバティブや為替予約取引等を行う場合があります。ブローカーの債務不履行等によって、ブローカーで保管されている証拠金の一部又は相当の額が失われる可能性や契約が履行されない可能性があります。ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

#### (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

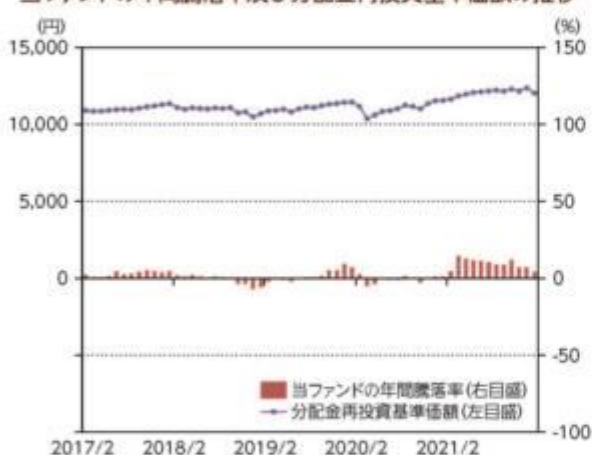
- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法

令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

### コア投資戦略ファンド(安定型)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

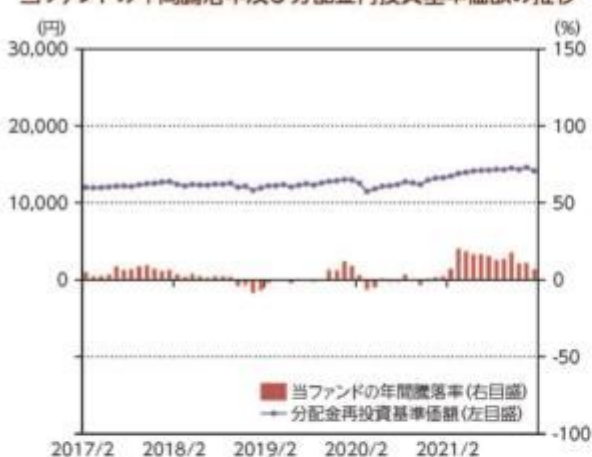


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



### コア投資戦略ファンド(成長型)

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

\*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

\*2017年2月～2022年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※各資産クラスの詳細については、後掲「各資産クラスの指数について」をご覧ください。

## 【参考情報】

### 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は各種は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」といふ。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は各種に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱落または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorganグローバル・エマージング・ マーケット・グロース・ハイ・イールド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜 3.0%）（1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

1：「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます（以下同じ。）。

「分配金再投資コース」（2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記 及び の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

確定拠出年金によるお申込みは申込手数料を無料とします。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

### (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する投資対象ファンドの解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図

るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をい、投資信託財産に繰り入れられま  
す。

### （３）【信託報酬等】

#### 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率  
1.518%（税抜 1.38%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬  
率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.968% （税抜 0.88%）	委託した資金の運用、基準価額の計 算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.495% （税抜 0.45%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内 でのファンドの管理、購入後の情報提 供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図 の実行の対価

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の  
6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

#### （参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の  
管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューフンド（適 格機関投資家専用）	年率 0.517% （税抜 0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機 関投資家専用）	年率 0.7095% （税抜 0.645%）
FOfs用国内株式EVIバリューフンド（適格 機関投資家専用）	年率 0.495% （税抜 0.45%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
日本債券ツイン戦略マザーファンド	ありません。
FOfs用世界物価連動債ファンド 為替ヘッ ジあり（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）



マニユライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	<p>毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。</p> <p>新発10年固定利付国債の利回り 信託報酬</p> <p>0.5%未満の場合・・・・・・・・・・年率 0.264% （税抜 0.24%）</p> <p>0.5%以上1%未満の場合・・・・・・・・年率 0.297% （税抜 0.27%）</p> <p>1%以上の場合・・・・・・・・・・年率 0.33% （税抜 0.3%）</p>
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.264%以内 （税抜 0.24%以内）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.814% （税抜 0.74%）
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.671% （税抜 0.61%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率 0.525%
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.451% （税抜 0.41%）
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	年率 0.8%以内
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
LM・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.33% （税抜 0.3%）
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）
米国株式LSマザーファンド	ありません。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マ ザーファンド	ありません。
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略 ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.506% ( 税抜 0.46% )
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファ ンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.418% ( 税抜 0.38% )
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率 0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハ イ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日 時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、 超過部分の15%。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

実質的な信託報酬率：年率1.518%～2.00946%程度（税抜 1.38%～1.8445%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜 0.0%～0.4645%程度））

#### （４）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（ ）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純

資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとしします。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・ FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるPTRディバースィファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（PTRディバースィファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・ 米国株式LSマザーファンド

主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかります。
- ・ マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかります。
- ・ 米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

## （5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離

課税を選択したものに限り、)及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

## ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について）をご参照ください。）

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

### 確定拠出年金の場合

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2022年1月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

以下は、2022年1月31日現在の状況について記載してあります。

## 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	16,772,214,627	36.52
	ルクセンブルク	477,044,915	1.04
	小計	17,249,259,542	37.56
投資証券	ルクセンブルク	1,504,126,904	3.27
	ケイマン	599,698,592	1.31
	小計	2,103,825,496	4.58
親投資信託受益証券	日本	26,133,318,840	56.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		441,439,445	0.96
合計(純資産総額)		45,927,843,323	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	2,344,624,777	1.8873	4,425,010,342	1.8495	4,336,383,525	9.44
日本	投資信託受益証券	マニユライフOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	4,063,527,883	1.0014	4,069,216,822	0.998	4,055,400,827	8.83
日本	親投資信託受益証券	日本債券ツイン戦略マザーファンド	4,035,330,425	0.9985	4,029,277,430	0.9945	4,013,136,107	8.74
日本	投資信託受益証券	明治安田F0Fs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	2,920,359,101	0.9999	2,920,160,516	0.9955	2,907,217,485	6.33
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	709,679,705	3.8849	2,757,034,686	4.0462	2,871,506,022	6.25
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	2,210,009,688	1.2644	2,794,336,250	1.2461	2,753,893,072	6.00
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,287,401,157	2.2877	2,945,280,052	2.0875	2,687,449,915	5.85
日本	投資信託受益証券	ノムラF0Fs用日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	2,792,885,689	0.9791	2,734,514,378	0.9354	2,612,465,273	5.69

日本	投資信託受益証券	F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	2,288,034,609	1.0767	2,463,526,863	1.0622	2,430,350,361	5.29
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	681,973,907	3.0772	2,098,570,107	3.0627	2,088,681,484	4.55
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	1,616,064,791	1.1393	1,841,182,616	1.1505	1,859,282,542	4.05
日本	親投資信託受益証券	コモディティ L S アルファ・マザーファンド	1,592,720,740	1.1304	1,800,411,525	1.1524	1,835,451,380	4.00
日本	親投資信託受益証券	グローバル R E I T インデックス マザーファンド	709,208,254	2.2787	1,616,072,849	2.4428	1,732,453,922	3.77
日本	親投資信託受益証券	米国株式 L S マザーファンド	1,611,709,843	0.9712	1,565,292,600	1.0230	1,648,779,169	3.59
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド	3,088,989,837	0.3979	1,229,109,057	0.4628	1,429,584,496	3.11
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	97,978.463	10,685.14	1,046,913,594	10,737.42	1,052,035,908	2.29
日本	投資信託受益証券	L M ・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）	631,034,019	1.2037	759,575,648	1.2137	765,885,988	1.67
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	58,000	10,250.79	594,545,918	10,339.63	599,698,592	1.31
日本	投資信託受益証券	F O F s用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	508,841,793	1.1312	575,601,836	1.1504	585,371,598	1.27
日本	投資信託受益証券	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	575,707,870	1.0241	589,640,000	1.0056	578,931,834	1.26
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	508,845,678	1.049	533,830,000	1.0251	521,617,704	1.14
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	620,000,000	0.8951	554,962,000	0.7728	479,136,000	1.04
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	39,454.546	12,801	505,057,643	12,091	477,044,915	1.04
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	292,559,717	1.4842	434,217,131	1.5576	455,691,015	0.99
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	297,232.739	1,796	533,830,000	1,521	452,090,996	0.98
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	146,670,330	1.7618	258,403,787	1.7513	256,863,748	0.56

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	37.56
投資証券	4.58
親投資信託受益証券	56.90
合計	99.04

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2013年 7月10日)	23,516,126,542	23,516,126,542	10,490	10,490
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	58,342,334,619	58,342,334,619	10,895	10,895
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	154,496,842,663	154,496,842,663	11,242	11,242
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	137,347,490,072	137,347,490,072	10,513	10,513
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	110,817,992,128	110,817,992,128	10,925	10,925
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	85,803,259,389	85,803,259,389	11,041	11,041
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	70,798,393,159	70,798,393,159	11,093	11,093
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	56,490,290,792	56,490,290,792	10,927	10,927
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	49,665,693,253	49,665,693,253	12,151	12,151
2021年 1月末日	53,982,750,142		11,552	
2月末日	52,333,951,741		11,625	
3月末日	52,046,367,227		11,841	
4月末日	51,029,479,568		11,956	
5月末日	50,350,381,742		12,069	
6月末日	49,676,455,665		12,110	
7月末日	49,298,192,391		12,155	
8月末日	49,030,873,460		12,219	
9月末日	48,203,960,946		12,152	
10月末日	48,374,804,828		12,289	
11月末日	47,086,233,985		12,155	
12月末日	47,413,412,998		12,347	
2022年 1月末日	45,927,843,323		12,026	

#### 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2012年 8月 7日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0

第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2012年 8月 7日～2013年 7月10日	4.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	3.9
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.2
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.5
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	3.9
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.1
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.5
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.5
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	11.2
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	1.1

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2012年 8月 7日～2013年 7月10日	27,864,099,720	5,445,932,097	22,418,167,623
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	41,397,767,660	10,267,152,046	53,548,783,237
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	103,350,778,566	19,468,922,195	137,430,639,608
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	33,825,686,496	40,608,431,436	130,647,894,668
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9,405,671,580	38,617,124,601	101,436,441,647
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	5,056,060,732	28,780,096,170	77,712,406,209
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	2,044,859,779	15,937,046,961	63,820,219,027
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1,139,540,754	13,263,598,230	51,696,161,551
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	865,618,090	11,688,284,382	40,873,495,259
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	620,231,605	3,121,548,410	38,372,178,454

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

## (1) 【投資状況】



資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	20,076,543,116	29.83
	ルクセンブルク	997,749,126	1.48
	小計	21,074,292,242	31.31
投資証券	ルクセンブルク	2,221,926,379	3.30
	ケイマン	601,900,933	0.89
	小計	2,823,827,312	4.20
親投資信託受益証券	日本	42,742,772,718	63.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		658,462,673	0.98
合計(純資産総額)		67,299,354,945	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	4,711,030,971	1.8870	8,889,715,443	1.8495	8,713,051,780	12.95
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,532,976,315	3.8849	5,955,459,687	4.0462	6,202,728,765	9.22
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,818,091,465	3.0772	5,594,631,057	3.0627	5,568,268,729	8.27
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	3,275,277,651	1.2644	4,141,261,062	1.2461	4,081,323,480	6.06
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,926,242,192	2.2843	4,400,209,130	2.0875	4,021,030,575	5.97
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,597,861,481	2.2787	3,641,046,957	2.4428	3,903,256,025	5.80
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリュウファンド(適格機関投資家専用)	3,285,099,454	1.1393	3,742,713,807	1.1505	3,779,506,921	5.62
日本	投資信託受益証券	ノムラF O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	3,218,429,102	0.9791	3,151,163,933	0.9354	3,010,518,582	4.47
日本	投資信託受益証券	F O F s 用 ビクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,701,947,891	1.0767	2,909,187,294	1.0622	2,870,009,049	4.26
日本	親投資信託受益証券	日本債券ツイン戦略マザーファンド	2,601,363,056	0.9984	2,597,200,876	0.9945	2,587,055,559	3.84
日本	投資信託受益証券	マニユライフF O F s 用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	2,561,689,492	1.0014	2,565,275,857	0.998	2,556,566,113	3.80
日本	親投資信託受益証券	コモディティL Sアルファ・マザーファンド	1,937,987,992	1.1304	2,190,701,627	1.1524	2,233,337,361	3.32
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	4,534,453,795	0.3974	1,801,991,939	0.4628	2,098,545,216	3.12
日本	親投資信託受益証券	米国株式L Sマザーファンド	2,004,423,457	0.9712	1,946,696,062	1.0230	2,050,525,196	3.05
日本	投資信託受益証券	L M・ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	1,584,545,490	1.2037	1,907,317,406	1.2137	1,923,162,861	2.86

日本	投資信託受益証券	明治安田F0Fs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,870,130,066	0.9999	1,870,000,000	0.9955	1,861,714,480	2.77
日本	投資信託受益証券	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	1,488,157,662	1.0241	1,524,171,077	1.0056	1,496,491,344	2.22
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	117,262.537	10,685.14	1,252,966,624	10,737.42	1,259,097,110	1.87
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,083,701,103	1.049	1,136,910,827	1.0251	1,110,902,000	1.65
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	698,670,075	1.4842	1,036,966,125	1.5576	1,088,248,508	1.62
ルクセンブルク	投資信託受益証券	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	82,519.984	12,801	1,056,338,315	12,091	997,749,126	1.48
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	633,023.846	1,795.99	1,136,910,827	1,521	962,829,269	1.43
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	399,809,303	1.7618	704,384,030	1.7513	700,186,032	1.04
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	58,213	10,250.79	596,729,337	10,339.63	601,900,933	0.89
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	755,000,000	0.8951	675,800,500	0.7728	583,464,000	0.87
日本	投資信託受益証券	F O F s用世界物価連動債ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	329,818,549	1.1312	373,090,742	1.1504	379,423,258	0.56

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	31.31
投資証券	4.20
親投資信託受益証券	63.51
合計	99.02

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3)【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)

第1期計算期間末	(2013年 7月10日)	13,582,006,627	13,582,006,627	11,293	11,293
第2期計算期間末	(2014年 7月10日)	63,378,377,545	63,378,377,545	11,880	11,880
第3期計算期間末	(2015年 7月10日)	239,900,173,382	239,900,173,382	12,488	12,488
第4期計算期間末	(2016年 7月11日)	202,671,985,249	202,671,985,249	11,145	11,145
第5期計算期間末	(2017年 7月10日)	167,571,594,666	167,571,594,666	12,161	12,161
第6期計算期間末	(2018年 7月10日)	123,579,669,423	123,579,669,423	12,401	12,401
第7期計算期間末	(2019年 7月10日)	103,980,033,191	103,980,033,191	12,463	12,463
第8期計算期間末	(2020年 7月10日)	79,565,923,251	79,565,923,251	12,289	12,289
第9期計算期間末	(2021年 7月12日)	72,527,176,232	72,527,176,232	14,261	14,261
	2021年 1月末日	76,343,490,500		13,276	
	2月末日	74,342,340,402		13,459	
	3月末日	74,485,215,789		13,817	
	4月末日	73,499,581,852		13,973	
	5月末日	73,340,998,423		14,143	
	6月末日	72,675,752,423		14,211	
	7月末日	71,951,502,677		14,251	
	8月末日	71,593,499,985		14,355	
	9月末日	70,362,776,835		14,304	
	10月末日	70,877,349,666		14,542	
	11月末日	68,995,376,973		14,327	
	12月末日	70,010,131,298		14,631	
	2022年 1月末日	67,299,354,945		14,154	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2012年 8月 7日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第1期計算期間	2012年 8月 7日～2013年 7月10日	12.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	5.2

第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	5.1
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	10.8
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.5
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.4
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	16.0
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	2.1

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2012年 8月 7日～2013年 7月10日	14,478,879,831	2,452,422,804	12,026,457,027
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	48,255,669,701	6,931,810,820	53,350,315,908
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	171,361,388,735	32,604,317,568	192,107,387,075
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	40,597,680,153	50,860,276,579	181,844,790,649
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	7,631,317,501	51,677,037,389	137,799,070,761
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	5,311,388,897	43,453,610,178	99,656,849,480
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	2,628,608,622	18,851,549,511	83,433,908,591
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1,388,452,268	20,074,397,173	64,747,963,686
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	1,202,439,160	15,092,710,750	50,857,692,096
第10期中間計算期間	2021年 7月13日～2022年 1月12日	874,910,045	4,056,592,442	47,676,009,699

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	469,555,700,120	99.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,011,367,539	0.85
合計(純資産総額)		473,567,067,659	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

##### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	3,891,925,000	0.82

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,178,400	1,835.78	16,849,565,457	2,245.50	20,610,097,200	4.35
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,135,100	10,890.26	12,361,535,906	12,720.00	14,438,472,000	3.05
日本	株式	キーエンス	電気機器	164,200	54,558.75	8,958,547,101	58,230.00	9,561,366,000	2.02
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,208,200	619.77	6,946,578,406	691.10	7,745,987,020	1.64
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,335,800	5,736.81	7,663,241,919	5,595.00	7,473,801,000	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	115,000	49,248.67	5,663,597,421	54,730.00	6,293,950,000	1.33
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,860,200	2,937.24	5,463,864,282	3,267.00	6,077,273,400	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	304,700	18,854.04	5,744,827,203	19,040.00	5,801,488,000	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	102,300	66,934.97	6,847,447,727	56,160.00	5,745,168,000	1.21
日本	株式	ダイキン工業	機械	230,900	21,766.34	5,025,848,035	23,825.00	5,501,192,500	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,066,300	8,135.02	8,674,374,919	5,011.00	5,343,229,300	1.13
日本	株式	HOYA	精密機器	353,600	14,495.40	5,125,576,796	14,755.00	5,217,368,000	1.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,337,300	3,113.40	4,163,561,773	3,877.00	5,184,712,100	1.09
日本	株式	日立製作所	電気機器	871,500	5,781.75	5,038,797,304	5,939.00	5,175,838,500	1.09
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,237,100	3,944.10	4,879,251,128	4,113.00	5,088,192,300	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,426,700	3,354.83	4,786,347,785	3,354.00	4,785,151,800	1.01
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,424,200	3,698.64	5,267,608,739	3,328.00	4,739,737,600	1.00
日本	株式	日本電産	電気機器	469,700	12,533.10	5,886,799,943	10,090.00	4,739,273,000	1.00
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,296,300	3,698.95	4,794,949,770	3,645.00	4,725,013,500	1.00
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,248,300	3,254.86	4,063,048,469	3,667.00	4,577,516,100	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	532,400	8,306.60	4,422,438,015	8,539.00	4,546,163,600	0.96
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	204,600	16,524.45	3,380,903,637	19,880.00	4,067,448,000	0.86
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	588,600	5,214.91	3,069,498,013	6,830.00	4,020,138,000	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	1,385,900	2,424.81	3,360,551,854	2,853.50	3,954,665,650	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	698,200	4,750.43	3,316,753,798	5,593.00	3,905,032,600	0.82

日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,693,200	1,465.31	3,946,381,442	1,434.00	3,862,048,800	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	1,424,000	2,535.27	3,610,238,034	2,565.00	3,652,560,000	0.77
日本	株式	ファナック	電気機器	159,000	26,181.70	4,162,891,192	22,460.00	3,571,140,000	0.75
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,285,600	1,663.68	3,802,520,768	1,550.00	3,542,680,000	0.75
日本	株式	デンソー	輸送用機器	399,000	7,543.83	3,009,991,542	8,494.00	3,389,106,000	0.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.27
		建設業	2.25
		食料品	3.36
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.66
		医薬品	4.73
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.61
		機械	5.36
		電気機器	18.15
		輸送用機器	8.64
		精密機器	2.67
		その他製品	2.28
		電気・ガス業	1.11
		陸運業	2.97
		海運業	0.55
		空運業	0.40
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	7.79
		卸売業	5.52
小売業	4.19		
銀行業	5.29		
証券、商品先物取引業	0.76		
保険業	2.24		

	その他金融業	1.18
	不動産業	1.93
	サービス業	5.79
	小計	99.15
合計		99.15

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	205	円	4,017,264,300	3,891,925,000	0.82

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 日本債券ツイン戦略マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	16,313,749,000	23.69
社債券	日本	48,516,311,000	70.44
	フランス	2,904,692,000	4.22
	小計	51,421,003,000	74.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,138,203,466	1.65
合計(純資産総額)		68,872,955,466	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	売建	日本	3,165,120,000	4.60

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券オプション	買建	日本	31,416,000	0.05
	売建	日本	469,000	0.00

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	社債券	第1回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	2,000,000,000	100.74	2,014,820,000	101.45	2,029,060,000	0.960	2079/12/24	2.95
日本	社債券	第5回A号太陽生命利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,800,000,000	100.14	1,802,611,000	99.98	1,799,640,000	0.640	2027/12/22	2.61
日本	国債証券	第70回利付国債(30年)	1,600,000,000	100.95	1,615,226,000	98.21	1,571,472,000	0.700	2051/3/20	2.28
日本	国債証券	第175回利付国債(20年)	1,300,000,000	100.96	1,312,480,000	99.39	1,292,187,000	0.500	2040/12/20	1.88
日本	社債券	第4回楽天利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,200,000,000	102.62	1,231,523,000	102.65	1,231,884,000	1.810	2055/11/4	1.79
日本	社債券	第5回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,200,000,000	101.74	1,220,954,000	101.46	1,217,580,000	1.020	2081/2/7	1.77
日本	国債証券	第173回利付国債(20年)	1,050,000,000	98.84	1,037,881,500	97.90	1,027,992,000	0.400	2040/6/20	1.49
日本	社債券	第1回アサヒグループHD利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,000,000,000	100.68	1,006,830,000	101.39	1,013,980,000	0.970	2080/10/15	1.47
日本	社債券	第6回みずほFG任意償還・無担保永久社債(劣後特約付)	1,000,000,000	101.36	1,013,610,000	100.77	1,007,750,000	1.130	9999/99/99	1.46
日本	社債券	第1回大樹生命保険利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	1,000,000,000	100.09	1,000,954,000	100.25	1,002,560,000	0.740	2051/7/2	1.46
フランス	社債券	第23回ルノー円貨社債	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	100.04	1,000,430,000	1.030	2023/7/6	1.45
フランス	社債券	BNPパリバ 0.557% 2027/05/20	1,000,000,000	100.00	1,000,000,000	99.80	998,070,000	0.557	2027/5/20	1.45
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	900,000,000	100.48	904,329,000	100.13	901,251,000	0.005	2026/9/20	1.31



日本	社債券	第3回ENEOSホールディングス利払繰延・期限前償還(劣後)	800,000,000	100.00	800,000,000	104.05	832,440,000	1.310	2081/6/15	1.21
日本	社債券	第3回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債(劣後特約)	800,000,000	100.00	800,000,000	101.67	813,400,000	1.300	9999/99/99	1.18
日本	社債券	第1回明治安田生命第1回劣後ローン流動化利払繰延・期限前(劣)	800,000,000	100.00	800,000,000	100.22	801,768,000	0.880	2051/8/2	1.16
日本	社債券	第2回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債(劣後特約付)	800,000,000	100.67	805,406,000	100.02	800,192,000	2.500	2022/2/9	1.16
日本	国債証券	第169回利付国債(20年)	800,000,000	96.64	773,144,000	96.87	775,032,000	0.300	2039/6/20	1.13
日本	社債券	第1回日本航空株式会社利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	700,000,000	100.00	700,000,000	101.60	711,263,000	1.600	2058/10/11	1.03
日本	社債券	第2回ENEOSホールディングス利払繰延・期限前償還(劣後)	700,000,000	100.25	701,764,000	101.01	707,126,000	0.970	2081/6/15	1.03
日本	社債券	第1回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	700,000,000	100.00	700,000,000	100.19	701,344,000	0.740	2081/10/14	1.02
日本	社債券	第7回イオン利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	600,000,000	102.32	613,974,000	105.17	631,056,000	1.740	2050/12/2	0.92
日本	社債券	第1回日本生命第5回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還(劣)	600,000,000	101.07	606,423,000	102.11	612,672,000	1.050	2050/9/23	0.89
日本	社債券	第48回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	600,000,000	102.25	613,524,000	100.89	605,352,000	2.130	2022/12/9	0.88
日本	社債券	第2回住友化学利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	600,000,000	100.12	600,750,000	100.60	603,648,000	0.840	2079/12/13	0.88
日本	社債券	第8回みずほFG任意償還・無担保永久社債(劣後特約付)	600,000,000	101.00	606,000,000	100.50	603,030,000	0.980	9999/99/99	0.88
日本	社債券	第2回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	600,000,000	100.00	600,000,000	100.26	601,584,000	0.885	2081/10/14	0.87
日本	社債券	第9回ソフトバンク株式会社無担保社債	600,000,000	99.47	596,868,000	99.99	599,982,000	0.480	2027/12/3	0.87
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	600,000,000	99.27	595,626,000	99.31	595,914,000	0.100	2031/12/20	0.87
日本	国債証券	第14回利付国債(40年)	600,000,000	98.69	592,152,000	96.44	578,670,000	0.700	2061/3/20	0.84

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(注3) 償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

#### □ 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	23.69
社債券	74.66

合計	98.35
----	-------

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	売建	21円		3,166,313,070	3,165,120,000	4.60

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券オプション	店頭	第149回利付国債(5年)コールオプション	売建	12,000,000円		960,000		
	店頭	第148回利付国債(5年)コールオプション	売建	19,000,000円		1,330,000	19,000	0.00
	店頭	第431回利付国債(2年)コールオプション	売建	30,000,000円		900,000		
	店頭	第148回利付国債(5年)コールオプション	売建	30,000,000円		1,800,000	180,000	0.00
	店頭	第149回利付国債(5年)コールオプション	売建	30,000,000円		30,000	270,000	0.00
	店頭	第149回利付国債(5年)プットオプション	買建	12,000,000円		1,296,000	4,572,000	0.01
	店頭	第148回利付国債(5年)プットオプション	買建	19,000,000円		1,843,000	5,814,000	0.01
	店頭	第431回利付国債(2年)プットオプション	買建	30,000,000円		2,070,000	3,600,000	0.01
	店頭	第148回利付国債(5年)プットオプション	買建	30,000,000円		2,610,000	8,370,000	0.01
	店頭	第149回利付国債(5年)プットオプション	買建	30,000,000円		960,000	9,060,000	0.01

(注1)評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	341,975,429,857	67.35
	イギリス	22,216,842,955	4.38

	カナダ	18,311,804,600	3.61
	スイス	16,580,167,848	3.27
	フランス	16,060,406,259	3.16
	ドイツ	13,251,910,051	2.61
	オランダ	9,253,574,211	1.82
	アイルランド	9,061,787,104	1.78
	オーストラリア	8,755,847,955	1.72
	スウェーデン	5,124,947,050	1.01
	デンマーク	3,682,650,526	0.73
	スペイン	3,582,674,993	0.71
	香港	3,260,798,072	0.64
	イタリア	2,820,923,109	0.56
	フィンランド	1,797,930,814	0.35
	ジャージー	1,547,754,147	0.30
	シンガポール	1,535,553,674	0.30
	ベルギー	1,216,687,825	0.24
	バミューダ	1,124,379,474	0.22
	イスラエル	1,061,295,528	0.21
	ノルウェー	1,008,404,264	0.20
	ケイマン	952,694,777	0.19
	キュラソー	490,707,697	0.10
	ルクセンブルク	409,122,423	0.08
	ニュージーランド	395,394,606	0.08
	オーストリア	359,089,350	0.07
	ポルトガル	261,203,784	0.05
	リベリア	165,746,078	0.03
	パナマ	154,431,522	0.03
	マン島	120,710,007	0.02
	小計	486,540,870,560	95.83
投資信託受益証券	オーストラリア	194,323,709	0.04
	香港	84,067,113	0.02
	小計	278,390,822	0.05
投資証券	アメリカ	9,726,594,630	1.92
	オーストラリア	632,520,740	0.12
	イギリス	332,462,910	0.07
	フランス	236,497,871	0.05
	シンガポール	198,638,607	0.04
	香港	168,550,758	0.03
	カナダ	54,946,111	0.01
	小計	11,350,211,627	2.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,561,185,468	1.88
合計(純資産総額)		507,730,658,477	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,944,431,728	1.37
	買建	カナダ	386,080,033	0.08
	買建	ドイツ	1,591,782,587	0.31
	買建	イギリス	183,448,409	0.04
	買建	オーストラリア	390,845,952	0.08

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		489,459,846	0.10

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,311,983	14,384.97	18,872,847,116	19,662.89	25,797,384,233	5.08
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	566,188	28,823.05	16,319,270,242	35,585.53	20,148,102,551	3.97
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	36,161	373,722.11	13,514,165,341	332,416.40	12,020,509,672	2.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	23,897	272,074.76	6,501,770,635	307,880.78	7,357,427,210	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	22,844	278,390.48	6,359,552,271	307,738.79	7,029,985,092	1.38
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	188,974	37,948.59	7,171,297,073	34,829.40	6,581,851,489	1.30
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	66,715	74,417.97	4,964,795,431	97,702.64	6,518,231,894	1.28

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	197,988	18,792.47	3,720,685,055	26,366.49	5,220,249,810	1.03
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	208,850	19,538.22	4,080,557,247	19,831.43	4,141,795,743	0.82
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	74,840	47,552.04	3,558,795,032	53,801.96	4,026,539,165	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	236,784	18,959.86	4,489,392,817	16,924.65	4,007,488,315	0.79
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	105,144	33,412.95	3,513,171,593	36,121.17	3,797,924,929	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	192,348	15,567.08	2,994,297,473	18,528.12	3,563,846,826	0.70
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	83,616	36,814.97	3,078,320,565	42,313.37	3,538,075,381	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	134,076	26,239.51	3,518,088,811	26,320.31	3,528,923,224	0.70
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	222,591	13,778.87	3,067,054,678	14,639.43	3,258,607,589	0.64
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	599,876	4,893.50	2,935,494,166	5,295.23	3,176,483,071	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	70,070	41,625.35	2,916,688,639	44,156.95	3,094,077,795	0.61
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	334,998	6,738.23	2,257,294,511	8,690.32	2,911,240,891	0.57
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	442,966	4,470.99	1,980,497,088	6,271.85	2,778,218,611	0.55
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	55,594	39,134.39	2,175,637,833	44,075.79	2,450,350,025	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,819	71,058.91	2,332,082,630	72,834.42	2,390,353,027	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	153,051	11,981.51	1,833,783,250	15,077.61	2,307,644,574	0.45
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	143,808	20,623.35	2,965,803,580	16,003.44	2,301,423,735	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	323,723	6,382.67	2,066,219,541	7,023.36	2,273,626,277	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	37,856	58,248.71	2,205,063,363	59,816.39	2,264,409,275	0.45
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	139,675	13,067.80	1,825,246,082	15,921.48	2,223,833,389	0.44
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	109,176	17,078.19	1,864,528,865	19,933.02	2,176,207,916	0.43
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	333,162	6,106.77	2,034,545,705	6,419.61	2,138,772,905	0.42
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	32,767	54,669.11	1,791,342,876	64,657.94	2,118,646,851	0.42

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.98
		素材	4.11
		資本財	6.01
		商業・専門サービス	1.18
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	2.25
		耐久消費財・アパレル	1.80
		消費者サービス	1.79
		メディア・娯楽	6.54
		小売	5.09
		食品・生活必需品小売り	1.41
		食品・飲料・タバコ	3.91
		家庭用品・パーソナル用品	1.73
		ヘルスケア機器・サービス	4.58
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.85
		銀行	6.29
		各種金融	4.74
		保険	3.03
		不動産	0.45
		ソフトウェア・サービス	11.48
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.63
		電気通信サービス	1.52
公益事業	2.88		
半導体・半導体製造装置	4.65		
	小計	95.83	
投資信託受益証券			0.05
投資証券			2.24
合計			98.12

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	272	アメリカドル	62,679,446.5	7,235,715,304	60,156,200	6,944,431,728	1.37

株価指数先物取引	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	17	カナダドル	4,258,000.5	385,050,985	4,269,380	386,080,033	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	41	スイスフラン	5,060,787	627,537,588	4,915,080	609,469,920	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	185	ユーロ	7,681,012.5	988,239,068	7,634,950	982,312,667	0.19
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	5,084,396	410,717,509	4,838,400	390,845,952	0.08
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	16	イギリスポンド	1,165,005	180,249,573	1,185,680	183,448,409	0.04

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,240,000.00	489,486,200	489,459,846	0.10

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	142,545,201,056	46.40
	フランス	29,328,653,142	9.55
	イタリア	26,101,314,401	8.50
	ドイツ	21,499,777,229	7.00
	イギリス	17,425,850,684	5.67
	スペイン	17,047,780,269	5.55
	ベルギー	6,598,895,838	2.15
	カナダ	5,939,641,771	1.93
	オランダ	5,639,980,327	1.84
	オーストラリア	4,689,371,872	1.53
	オーストリア	4,094,512,920	1.33
	中国	2,731,100,907	0.89
	アイルランド	2,299,318,561	0.75
	メキシコ	2,133,132,650	0.69

	フィンランド	1,744,957,052	0.57
	マレーシア	1,499,660,053	0.49
	ポーランド	1,450,750,681	0.47
	シンガポール	1,327,536,132	0.43
	デンマーク	1,312,178,641	0.43
	イスラエル	1,308,230,433	0.43
	スウェーデン	845,117,194	0.28
	ノルウェー	728,876,891	0.24
	小計	298,291,838,704	97.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,894,151,537	2.90
合計(純資産総額)		307,185,990,241	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	3,004,267,388	0.98
	買建	ドイツ	3,234,724,689	1.05

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		7,106,809,057	2.31

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 2% 08/15/51	15,150,000	11,858.87	1,796,619,502	11,325.74	1,715,850,555	2.000	2051/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	15,950,000	10,644.83	1,697,850,494	10,512.25	1,676,704,673	0.625	2030/8/15	0.55



アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	15,050,000	11,080.43	1,667,605,655	10,929.82	1,644,938,389	1.125	2031/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	14,500,000	11,462.97	1,662,131,036	11,183.25	1,621,571,250	1.250	2028/9/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.75% 08/15/41	14,500,000	11,282.30	1,635,934,872	10,789.13	1,564,423,949	1.750	2041/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/51	13,600,000	10,784.66	1,466,714,014	10,993.85	1,495,164,449	1.875	2051/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	14,100,000	10,688.12	1,507,025,015	10,541.11	1,486,297,215	0.625	2030/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.25% 03/15/24	13,000,000	11,545.80	1,500,954,487	11,314.02	1,470,822,851	0.250	2024/3/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	12,680,000	11,279.12	1,430,193,254	11,012.79	1,396,422,490	1.250	2031/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/23	12,000,000	11,499.44	1,379,932,819	11,392.48	1,367,098,200	0.250	2023/9/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	11,830,000	11,316.12	1,338,697,167	11,112.00	1,314,549,828	0.750	2026/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.5% 02/28/26	11,500,000	11,417.73	1,313,039,813	11,060.14	1,271,916,571	0.500	2026/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	11,150,000	11,759.34	1,311,167,027	11,402.40	1,271,368,233	1.625	2031/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.25% 11/15/23	11,000,000	11,483.85	1,263,224,134	11,370.16	1,250,718,000	0.250	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	11,000,000	11,541.74	1,269,591,987	11,164.31	1,228,074,175	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 11/15/26	10,220,000	12,220.40	1,248,925,518	11,754.58	1,201,318,877	2.000	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	12,274.96	1,245,909,420	11,830.79	1,200,825,819	2.250	2024/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	10,863.08	1,211,233,913	10,714.27	1,194,641,662	0.875	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/23	10,150,000	11,570.60	1,174,416,442	11,461.47	1,163,340,058	0.250	2023/4/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	10,210,000	11,301.80	1,153,914,482	11,100.27	1,133,338,332	1.125	2028/8/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.125% 01/15/24	10,000,000	11,513.78	1,151,378,715	11,315.14	1,131,514,920	0.125	2024/1/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 05/15/24	10,000,000	11,482.81	1,148,281,103	11,288.76	1,128,876,943	0.250	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/31/25	10,000,000	11,383.01	1,138,301,534	11,064.20	1,106,420,250	0.250	2025/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	10,000,000	11,150.78	1,115,078,250	10,845.04	1,084,504,693	0.625	2027/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.25% 02/15/27	8,950,000	12,375.07	1,107,569,467	11,895.73	1,064,667,947	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,500,000	11,691.41	1,110,684,603	11,206.24	1,064,593,544	1.250	2028/6/30	0.35
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,037.50	1,095,150,420	12,568.53	1,055,756,520	3.125	2028/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	9,500,000	11,066.90	1,051,356,277	10,774.24	1,023,553,717	0.375	2027/7/31	0.33
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/27	8,550,000	12,363.80	1,057,105,279	11,904.29	1,017,817,572	2.250	2027/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/15/24	9,010,000	11,541.11	1,039,854,372	11,295.98	1,017,768,197	0.375	2024/7/15	0.33

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.10
合計	97.10

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
-------	----	-----	-------	---------	----	----	-------------	----------	-------------	----------	----------

債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	79	アメリカドル	9,506,893.2	1,097,475,750	9,413,960.74	1,086,747,627	0.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	58	アメリカドル	7,508,865.67	866,823,453	7,421,281.54	856,712,741	0.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	59	アメリカドル	9,349,821.45	1,079,343,388	9,189,250	1,060,807,020	0.35
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	34	ユーロ	3,810,986.4	490,321,510	3,808,850	490,046,641	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	48	ユーロ	6,405,060.8	824,075,122	6,371,040	819,698,006	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	88	ユーロ	15,135,964.8	1,947,393,232	14,961,760	1,924,980,042	0.63

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	24,400,000.00	2,803,348,451	2,816,343,160	0.92
	カナダドル	買建	2,960,000.00	270,736,745	267,641,128	0.09
	ユーロ	買建	22,210,000.00	2,900,726,017	2,857,896,181	0.93
	イギリスポンド	買建	2,830,000.00	443,081,523	437,736,193	0.14
	香港・オフショア人民元	買建	40,127,601.56	727,320,803	727,192,395	0.24

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	中国	8,170,685,349	9.81
	インドネシア	8,024,705,218	9.63
	メキシコ	7,546,823,434	9.06
	タイ	7,292,274,311	8.75
	ブラジル	7,126,658,053	8.55
	マレーシア	7,023,405,615	8.43
	南アフリカ	6,963,468,468	8.36
	ポーランド	5,686,677,749	6.82
	ロシア	5,224,844,112	6.27
	チェコ	3,736,112,816	4.48

	コロンビア	3,200,803,499	3.84
	ハンガリー	2,793,618,348	3.35
	ルーマニア	2,407,739,625	2.89
	ペルー	1,739,476,780	2.09
	チリ	1,625,741,395	1.95
	トルコ	895,566,233	1.07
	ドミニカ共和国	114,473,302	0.14
	フィリピン	109,322,355	0.13
	ウルグアイ	95,804,776	0.11
	小計	79,778,201,438	95.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,544,721,690	4.25
合計(純資産総額)		83,322,923,128	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	62,800,000,000	3.35	2,108,177,699	3.20	2,013,970,762	9.850	2027/6/28	2.42
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/24	92,100,000	1,680.91	1,548,118,518	1,732.30	1,595,455,770	0.000	2024/1/1	1.91
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/23	70,000,000	1,775.73	1,243,017,964	1,823.55	1,276,489,462	0.000	2023/7/1	1.53
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	146,600,000	819.78	1,201,800,413	820.59	1,202,989,924	10.500	2026/12/21	1.44
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/23	56,600,000	2,098.81	1,187,928,283	2,106.18	1,192,098,100	10.000	2023/1/1	1.43
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	138,700,000	685.75	951,144,179	682.78	947,020,298	8.000	2030/1/31	1.14
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	151,100,000	622.96	941,304,039	619.24	935,681,915	8.750	2048/2/28	1.12
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	172,100,000	526.42	905,969,839	519.83	894,634,046	5.750	2026/3/5	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	159,500,000	563.14	898,223,152	553.00	882,050,023	7.500	2027/6/3	1.06
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	41,200,000	2,025.96	834,695,782	2,048.99	844,187,630	10.000	2027/1/1	1.01
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	29,800,000	2,829.33	843,140,760	2,799.28	834,186,122	3.885	2029/8/15	1.00
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	32,500,000,000	2.74	891,889,421	2.49	811,463,998	7.250	2034/10/18	0.97
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	136,900,000	595.78	815,623,418	582.44	797,370,019	8.500	2029/5/31	0.96
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000	2,858.58	743,231,074	2,840.60	738,557,747	3.955	2025/9/15	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	568.06	729,393,720	560.91	720,218,547	8.000	2024/9/5	0.86
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	41,850,000	1,609.30	673,496,167	1,648.69	689,978,636	0.000	2024/7/1	0.83
タイ	国債証券	THAIGB 3.65% 06/20/31	175,500,000	398.61	699,564,585	390.58	685,470,357	3.650	2031/6/20	0.82

ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	31,800,000	2,050.58	652,086,605	2,080.54	661,614,110	10.000	2025/1/1	0.79
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	97,200,000	668.21	649,500,674	665.09	646,474,478	8.250	2032/3/31	0.78
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	23,100,000	2,817.30	650,797,446	2,792.25	645,010,316	3.733	2028/6/15	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	115,600,000	572.85	662,216,024	557.17	644,100,005	7.750	2031/5/29	0.77
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000	2,773.48	668,410,208	2,651.99	639,129,950	2.500	2026/7/25	0.77
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	97,700,000	635.23	620,620,492	628.96	614,496,851	8.500	2037/1/31	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 12/07/23	105,950,000	566.95	600,692,086	559.50	592,794,136	8.000	2023/12/7	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 10% 12/05/24	100,250,000	600.26	601,761,138	589.78	591,258,742	10.000	2024/12/5	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	108,500,000	557.70	605,113,930	541.51	587,547,370	7.750	2042/11/13	0.71
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	22,600,000	2,787.92	630,071,956	2,578.71	582,790,325	2.750	2029/10/25	0.70
タイ	国債証券	THAIGB 1.45% 12/17/24	160,000,000	351.24	561,985,828	350.56	560,903,760	1.450	2024/12/17	0.67
マレーシア	国債証券	MGS 4.059% 09/30/24	19,550,000	2,854.83	558,119,922	2,839.28	555,079,916	4.059	2024/9/30	0.67
ポーランド	国債証券	POLGB 2.5% 01/25/23	19,600,000	2,803.94	549,574,039	2,785.53	545,964,805	2.500	2023/1/25	0.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.75
合計	95.75

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### J - REITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	105,354,777,000	96.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,033,788,366	3.69
合計(純資産総額)		109,388,565,366	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	4,000,546,000	3.66

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	11,445	708,577.76	8,109,672,503	664,000	7,599,480,000	6.95
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,817	678,875.75	6,664,523,324	630,000	6,184,710,000	5.65
日本	投資証券	G L P 投資法人	31,794	184,324.92	5,860,426,631	184,700	5,872,351,800	5.37
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,061	371,443.11	5,965,747,790	358,000	5,749,838,000	5.26
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,745	166,214.92	5,276,492,900	159,300	5,056,978,500	4.62
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,740	325,473.38	4,797,477,742	342,000	5,041,080,000	4.61
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	49,530	101,261.83	5,015,498,448	96,700	4,789,551,000	4.38
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,815	360,532.01	3,538,621,746	338,500	3,322,377,500	3.04
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	19,560	181,342.02	3,547,050,104	164,800	3,223,488,000	2.95
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	22,099	142,167.71	3,141,764,387	135,500	2,994,414,500	2.74
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	13,936	206,916.82	2,883,592,818	192,500	2,682,680,000	2.45
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,708	411,995.75	2,763,667,509	375,000	2,515,500,000	2.30
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	29,798	85,109.12	2,536,081,626	78,200	2,330,203,600	2.13
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,017	190,441.79	2,288,539,009	183,600	2,206,321,200	2.02
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	3,037	708,113.56	2,150,540,882	696,000	2,113,752,000	1.93
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,390	633,830.55	2,148,685,586	622,000	2,108,580,000	1.93
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,649	588,235.39	2,146,470,967	566,000	2,065,334,000	1.89
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,414	330,771.14	2,121,566,137	318,000	2,039,652,000	1.86
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,232	452,630.86	2,368,164,663	388,500	2,032,632,000	1.86
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,545	154,436.87	1,782,973,757	145,900	1,684,415,500	1.54
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,074	66,321.78	1,994,561,471	55,800	1,678,129,200	1.53
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,441	508,871.02	1,751,025,209	484,500	1,667,164,500	1.52
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,544	155,214.88	1,791,800,600	141,000	1,627,704,000	1.49

日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	43,207	43,138.08	1,863,867,307	36,050	1,557,612,350	1.42
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,158	170,863.43	1,564,767,305	165,200	1,512,901,600	1.38
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,075	730,367.87	1,515,513,346	719,000	1,491,925,000	1.36
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,265	113,070.38	1,499,878,707	112,200	1,488,333,000	1.36
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	9,410	152,119.32	1,431,442,851	154,400	1,452,904,000	1.33
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,420	324,252.12	1,433,194,386	308,000	1,361,360,000	1.24
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,705	215,914.19	1,447,704,701	200,200	1,342,341,000	1.23

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.31
合計	96.31

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,068	円	4,149,442,000	4,000,546,000	3.66

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	72,260,727,321	76.32
	オーストラリア	6,014,525,794	6.35
	イギリス	5,188,404,184	5.48
	シンガポール	3,119,335,327	3.29
	カナダ	1,812,911,150	1.91
	フランス	1,767,530,248	1.87

香港	1,256,173,261	1.33
ベルギー	1,211,661,151	1.28
スペイン	382,728,628	0.40
ニュージーランド	354,141,729	0.37
ガーンジー	277,327,776	0.29
オランダ	178,453,625	0.19
韓国	164,618,206	0.17
ドイツ	114,712,226	0.12
アイルランド	104,811,248	0.11
イスラエル	85,192,083	0.09
イタリア	28,888,467	0.03
小計	94,322,142,424	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	359,440,118	0.38
合計(純資産総額)	94,681,582,542	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		125,920,047	0.13

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	386,574	17,162.46	6,634,562,668	17,901.28	6,920,169,724	7.31
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	47,040	92,140.74	4,334,300,636	81,680.72	3,842,261,370	4.06
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	79,664	37,565.33	2,992,604,480	41,624.20	3,315,950,332	3.50
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	171,605	19,305.03	3,312,839,879	16,900.41	2,900,195,888	3.06
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	148,138	18,169.10	2,691,534,373	17,186.70	2,546,004,431	2.69
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	295,260	7,951.50	2,347,762,016	8,021.92	2,368,553,753	2.50
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	227,120	9,845.87	2,236,195,720	9,703.88	2,203,946,679	2.33
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	72,893	27,736.76	2,021,816,288	28,093.47	2,047,817,921	2.16
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	177,944	9,892.05	1,760,231,586	10,261.46	1,825,965,523	1.93

オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	886,343	1,906.40	1,689,731,386	1,852.28	1,641,760,198	1.73
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73,517	23,913.39	1,758,041,134	21,882.80	1,608,758,278	1.70
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	69,779	22,881.36	1,596,638,587	22,731.29	1,586,166,713	1.68
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	310,944	4,692.63	1,459,147,008	4,801.14	1,492,888,661	1.58
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	59,980	23,433.16	1,405,521,273	23,637.49	1,417,776,914	1.50
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	198,230	6,550.06	1,298,419,504	6,602.01	1,308,717,156	1.38
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	60,353	22,365.34	1,349,815,703	21,633.45	1,305,643,970	1.38
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	33,880	39,322.32	1,332,240,445	38,342.24	1,299,035,145	1.37
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	625,864	2,051.58	1,284,014,572	1,977.32	1,237,534,406	1.31
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	207,705	6,081.37	1,263,132,866	5,942.85	1,234,359,908	1.30
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	280,422	3,921.49	1,099,673,976	4,033.47	1,131,074,734	1.19
香港	投資証券	LINK REIT	1,089,400	1,028.70	1,120,668,612	988.56	1,076,945,434	1.14
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	327,065	3,369.69	1,102,108,837	3,258.87	1,065,862,709	1.13
アメリカ	投資証券	UDR INC	151,083	6,389.60	965,360,541	6,510.81	983,673,614	1.04
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	53,124	18,851.35	1,001,459,224	18,277.61	970,980,030	1.03
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	73,915	13,549.19	1,001,488,586	13,079.35	966,760,303	1.02
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	326,054	2,688.59	876,628,002	2,793.64	910,880,105	0.96
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	98,486	8,868.10	873,383,776	8,898.11	876,339,774	0.93
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	315,119	2,465.79	777,019,926	2,568.53	809,395,756	0.85
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	90,411	9,752.37	881,721,633	8,914.27	805,948,680	0.85
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	152,781	5,485.70	838,112,076	5,194.80	793,666,739	0.84

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.62
合計	99.62

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	110,000.00	12,699,500	12,698,279	0.01
	ユーロ	売建	880,000.00	113,228,720	113,221,768	0.12

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。



## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アイルランド	13,192,621,728	42.95
	ルクセンブルク	13,086,047,520	42.61
	イギリス	2,917,965,336	9.50
	アメリカ	543,202,920	1.77
	ジャージー	508,397,760	1.66
	小計	30,248,235,264	98.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		464,525,021	1.51
合計(純資産総額)		30,712,760,285	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/24/22	76,000,000	14,908.75	11,330,655,336	17,358.71	13,192,621,728	0.000	2022/10/24	42.95
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 024 05/31/22	26,000,000	11,865.54	3,085,041,648	13,418.74	3,488,873,856	0.000	2022/5/31	11.36
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 025 10/31/22	28,000,000	11,514.39	3,224,031,408	12,003.45	3,360,966,336	0.000	2022/10/31	10.94
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 023 03/31/22	21,000,000	12,549.48	2,635,391,304	14,974.87	3,144,724,128	0.000	2022/3/31	10.24
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 026 12/30/22	26,000,000	11,894.76	3,092,637,600	11,890.32	3,091,483,200	0.000	2022/12/30	10.07
イギリス	社債券	CS USD COM 018 06/30/22	11,000,000	11,614.10	1,277,551,392	13,392.19	1,473,141,384	0.000	2022/6/30	4.80
イギリス	社債券	BAR USD COM 039 07/29/22	11,000,000	11,632.88	1,279,617,768	13,134.76	1,444,823,952	0.000	2022/7/29	4.70
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	3,030.30	454,545,000	3,621.35	543,202,920	0.000	2036/6/12	1.77
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	1,092.06	436,824,960	1,270.99	508,397,760	0.000	9999/99/99	1.66

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(注3)償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
社債券	98.49
合計	98.49

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	27,222,774,606	99.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		40,446,301	0.15
合計(純資産総額)		27,263,220,907	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	売建		27,745,912,378	101.77

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 （％）
------	----	-----	----	---------------	---------------	--------------	--------------	-----------------

アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	6,929,695	3,968.82	27,502,762,003	3,928.42	27,222,774,606	99.85
------	----------	--------------------	-----------	----------	----------------	----------	----------------	-------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.85
合計	99.85

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	240,355,869.00	27,738,124,848	27,745,912,378	101.77

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 米国株式LSマザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	18,097,032,408	96.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		610,810,777	3.26
合計(純資産総額)		18,707,843,185	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		18,001,698,000	96.23

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/22	140,000,000	12,236.96	17,131,750,372	12,926.45	18,097,032,408	0.000	2022/10/18	96.74

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	96.74
合計	96.74

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	156,000,000.00	17,733,768,000	18,001,698,000	96.23

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

### コモディティ L S アルファ・マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	20,882,346,000	99.19

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		171,072,591	0.81
合計(純資産総額)		21,053,418,591	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 07/13/22	18,030,000,000	112.19	20,229,324,000	115.82	20,882,346,000	0.000	2022/7/13	99.19

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	99.19
合計	99.19

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	17,800,860,000	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		164,629,583	0.92
合計(純資産総額)		17,965,489,583	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アイルラ ンド	社債券	STAR HEL IOS 0% 1 0 / 18 / 22	23,100,000,000	90.45	20,895,704,000	77.06	17,800,860,000	0.000	2022/10/18	99.08

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	99.08
合計	99.08

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

### 投資不動産物件


該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

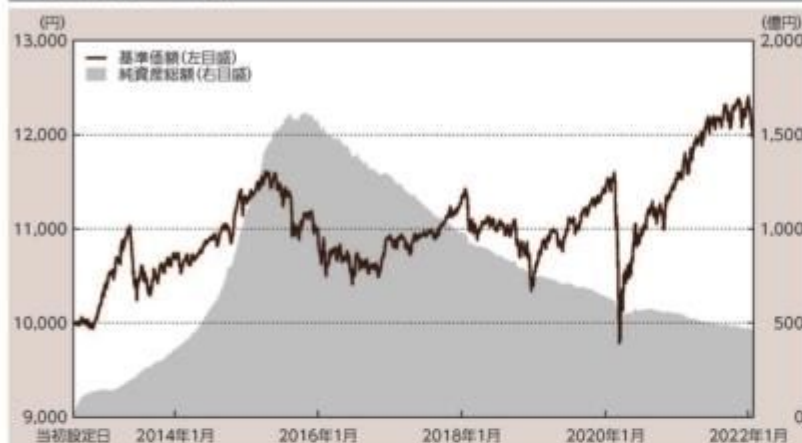
該当事項はありません。

### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2012年8月7日  
作成基準日：2022年1月31日

**コア投資戦略ファンド(安定型)****基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	12,026円
純資産総額	459.28億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年7月	0円
2018年7月	0円
2019年7月	0円
2020年7月	0円
2021年7月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	9.4%
マニュアルFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	8.8%
日本債券ツイン戦略マザーファンド	8.7%
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	6.3%
外国株式インデックス マザーファンド	6.3%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.0%
J-REIT インデックス マザーファンド	5.9%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	5.7%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	5.3%
外国債券インデックス マザーファンド	4.5%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

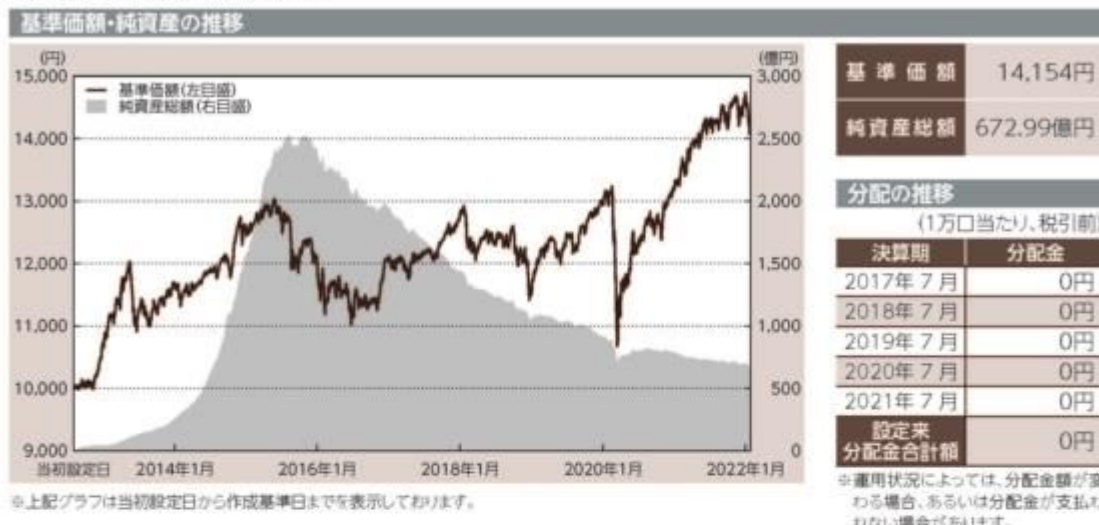
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。



当初設定日：2012年8月7日  
作成基準日：2022年1月31日

## コア投資戦略ファンド(成長型)

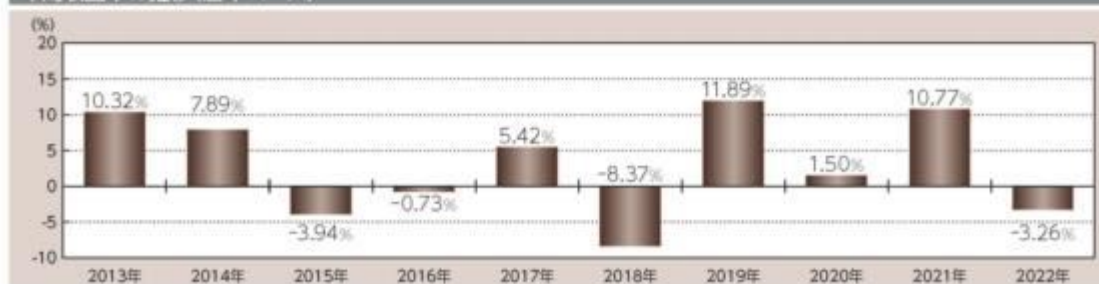


## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内株式インデックス マザーファンド	12.9%
外国株式インデックス マザーファンド	9.2%
外国債券インデックス マザーファンド	8.3%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.1%
J-REIT インデックス マザーファンド	6.0%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.8%
国内株式アクティブ/バリューファンド(適格機関投資家専用)	5.6%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	4.5%
FOFs 用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	4.3%
日本債券ツイン戦略マザーファンド	3.8%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### < 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。



#### < 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### < 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1円以上1円単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

ただし、確定拠出年金によるお申込みは1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

ドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### <スイッチング>

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（ ）の取扱いを行う場合があります。上記受付不可日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

#### <一部解約の受付>

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### <一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください（ただし、確定拠出年金による一部解約は1口単位）。

#### <解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）

でご覧いただけます。

#### <一部解約代金の支払い>

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

#### <受付不可日>

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとしします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

#### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### <その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

・外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

・公社債等（仕組債を含みます。）

計算日（ ）における次のa.からc.までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

b. 価格情報会社の提供する価額

外貨建資産等の円換算

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の

仲値によって計算します。

#### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （２）【保管】

該当事項はありません。

#### （３）【信託期間】

無期限とします。（2012年 8月 7日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### （４）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2012年8月7日から2013年7月10日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### （５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

##### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（１）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行いま

す。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記からまでの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記からまでの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

#### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

##### (1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

##### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記

録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知っている受益者に対して交付します。

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。



### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2020年7月11日から2021年7月12日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,348,496,958	740,133,326
投資信託受益証券	19,989,445,779	16,809,672,696
投資証券	1,761,944,141	1,691,487,423
親投資信託受益証券	33,875,654,012	30,824,364,901
未収入金	-	69,629,894
流動資産合計	56,975,540,890	50,135,288,240
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	50,725,170	74,054,499
未払受託者報酬	15,711,117	14,298,977
未払委託者報酬	417,915,654	380,352,982
未払利息	724	1,129
その他未払費用	897,433	887,400
流動負債合計	485,250,098	469,594,987
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	51,696,161,551	40,873,495,259
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,794,129,241	8,792,197,994
(分配準備積立金)	1,025,235,747	4,500,409,447
元本等合計	56,490,290,792	49,665,693,253
純資産合計	56,490,290,792	49,665,693,253
負債純資産合計	56,975,540,890	50,135,288,240

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	自	2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
営業収益				
受取配当金		80,494,761		-
受取利息		4,726		1,802
有価証券売買等損益		184,099,866		6,574,424,164
その他収益		4,094		-
営業収益合計		264,603,447		6,574,425,966
営業費用				
支払利息		487,602		211,743
受託者報酬		34,240,966		29,870,203
委託者報酬		910,809,376		794,547,635
その他費用		1,823,469		1,791,581
営業費用合計		947,361,413		826,421,162
営業利益又は営業損失（ ）		682,757,966		5,748,004,804
経常利益又は経常損失（ ）		682,757,966		5,748,004,804
当期純利益又は当期純損失（ ）		682,757,966		5,748,004,804
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		175,571,889		799,444,520
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,978,174,132		4,794,129,241
剰余金増加額又は欠損金減少額		125,555,899		137,898,418
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		125,555,899		137,898,418
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,451,270,935		1,088,389,949
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,451,270,935		1,088,389,949
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,794,129,241		8,792,197,994

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第9期計算期間は2020年 7月11日から2021年 7月12日までとなっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	51,696,161,551口	40,873,495,259口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.0927円 (1万口当たり純資産額) (10,927円)	1口当たり純資産額 1.2151円 (1万口当たり純資産額) (12,151円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日													
分配金の計算過程 <table border="1" data-bbox="172 2004 753 2098"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	- 円	分配金の計算過程 <table border="1" data-bbox="836 2004 1417 2098"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>380,458,763円</td> </tr> </tbody> </table>		項目			費用控除後の配当等収益額	A	380,458,763円
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	- 円												
項目														
費用控除後の配当等収益額	A	380,458,763円												

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日			第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日		
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	3,324,425,467円
収益調整金額	C	3,768,893,494円	収益調整金額	C	4,291,788,547円
分配準備積立金額	D	1,025,235,747円	分配準備積立金額	D	795,525,217円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,794,129,241円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,792,197,994円
当ファンドの期末残存口数	F	51,696,161,551口	当ファンドの期末残存口数	F	40,873,495,259口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	927円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,151円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2021年 7月12日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	第9期 (2021年 7月12日現在)
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	63,820,219,027円	51,696,161,551円
期中追加設定元本額	1,139,540,754円	865,618,090円
期中一部解約元本額	13,263,598,230円	11,688,284,382円

( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	

投資信託受益証券	181,714,390	571,640,530
投資証券	18,612,862	77,881,481
親投資信託受益証券	161,879,587	4,331,871,579
合計	38,447,665	4,981,393,590

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラ F O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略 ファンド（適格機関投資家専用）	2,843,673,689	2,784,240,908	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機 関投資家専用）	1,780,158,791	2,028,134,910	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	44,891.367	574,654,388	
	大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド （適格機関投資家専用）	36,532,976	36,942,145	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド （適格機関投資家専用）	399,253,717	592,572,366	
	L M ・ ウェスタン ・ グローバル債券ファンド （適格機関投資家専用）	639,001,019	769,165,526	
	F O F s 用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為 替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	1,768,042,689	1,885,440,723	
	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リ ンクファンド（適格機関投資家専用）	2,335,009,609	2,514,104,846	
	F O F s 用世界物価連動債ファンド 為替ヘッ ジあり（適格機関投資家専用）	597,090,793	675,429,105	
	マニユライフ F O F s 用日本債券ストラテジッ クファンド（適格機関投資家専用）	4,942,068,883	4,948,987,779	
投資信託受益証券合計		15,340,877,057.367	16,809,672,696	
投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	102,660.471	1,096,941,505	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	58,000	594,545,918	
投資証券合計		160,660.471	1,691,487,423	
親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	1,308,419,559	2,998,505,103	

グローバルREITインデックス マザーファンド	878,873,279	2,002,688,540	
国内株式インデックス マザーファンド	2,492,806,352	4,702,429,902	
外国株式インデックス マザーファンド	1,244,951,979	4,836,513,943	
外国債券インデックス マザーファンド	911,972,296	2,806,321,149	
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	2,678,129,478	1,022,242,021	
新興国債券インデックス マザーファンド	146,670,330	258,403,787	
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	2,248,503,799	2,843,008,203	
コモディティLSアルファ・マザーファンド	1,766,479,321	1,996,828,224	
米国株式LSマザーファンド	1,868,581,812	1,814,766,655	
日本債券ツイン戦略マザーファンド	4,995,188,157	4,987,695,374	
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	620,000,000	554,962,000	
親投資信託受益証券合計	21,160,576,362	30,824,364,901	
合計		49,325,525,020	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2020年7月11日から2021年7月12日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	2,065,574,340	1,233,608,553
投資信託受益証券	21,816,006,642	19,527,849,095
投資証券	1,980,991,798	1,849,695,961
親投資信託受益証券	54,356,129,724	50,583,256,273
未収入金	-	178,577,900
流動資産合計	80,218,702,504	73,372,987,782
<b>資産合計</b>	<b>80,218,702,504</b>	<b>73,372,987,782</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	44,089,015	277,882,039
未払受託者報酬	22,019,137	20,542,678
未払委託者報酬	585,709,043	546,435,120
未払利息	1,109	1,882
その他未払費用	960,949	949,831
流動負債合計	652,779,253	845,811,550
<b>負債合計</b>	<b>652,779,253</b>	<b>845,811,550</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	64,747,963,686	50,857,692,096
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	14,817,959,565	21,669,484,136
(分配準備積立金)	1,892,244,012	9,950,893,116
元本等合計	79,565,923,251	72,527,176,232
<b>純資産合計</b>	<b>79,565,923,251</b>	<b>72,527,176,232</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>80,218,702,504</b>	<b>73,372,987,782</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	自	2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
営業収益				
受取配当金		48,512,702		-
受取利息		5,625		2,654
有価証券売買等損益		642,927,232		12,712,521,075
その他収益		9,091		-
営業収益合計		691,454,650		12,712,523,729
営業費用				
支払利息		612,695		315,679
受託者報酬		48,864,341		42,770,900
委託者報酬		1,299,791,414		1,137,705,952
その他費用		1,970,316		1,920,587
営業費用合計		1,351,238,766		1,182,713,118
営業利益又は営業損失（ ）		659,784,116		11,529,810,611
経常利益又は経常損失（ ）		659,784,116		11,529,810,611
当期純利益又は当期純損失（ ）		659,784,116		11,529,810,611
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		470,657,444		1,624,419,425
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		20,546,124,600		14,817,959,565
剰余金増加額又は欠損金減少額		347,737,584		409,298,359
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		347,737,584		409,298,359
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,945,461,059		3,463,164,974
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,945,461,059		3,463,164,974
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,817,959,565		21,669,484,136

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第9期計算期間は2020年 7月11日から2021年 7月12日までとなっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	64,747,963,686口	50,857,692,096口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2289円 (1万口当たり純資産額) (12,289円)	1口当たり純資産額 1.4261円 (1万口当たり純資産額) (14,261円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日			第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	730,530,432円

第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日			第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日		
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	7,765,131,796円
収益調整金額	C	12,925,715,553円	収益調整金額	C	11,718,591,020円
分配準備積立金額	D	1,892,244,012円	分配準備積立金額	D	1,455,230,888円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,817,959,565円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	21,669,484,136円
当ファンドの期末残存口数	F	64,747,963,686口	当ファンドの期末残存口数	F	50,857,692,096口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,288円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,260円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2021年 7月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	第9期 (2021年 7月12日現在)
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	第8期 自 2019年 7月11日 至 2020年 7月10日	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	83,433,908,591円	64,747,963,686円
期中追加設定元本額	1,388,452,268円	1,202,439,160円
期中一部解約元本額	20,074,397,173円	15,092,710,750円

( 有価証券に関する注記 )

売買目的有価証券

種類	第8期 (2020年 7月10日現在)	第9期 (2021年 7月12日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

投資信託受益証券	284,069,776	1,332,349,247
投資証券	20,984,740	86,298,172
親投資信託受益証券	455,028,725	8,466,896,765
合計	149,974,209	9,885,544,184

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラ F O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略 ファンド（適格機関投資家専用）	3,218,429,102	3,151,163,933	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機 関投資家専用）	3,590,910,454	4,091,124,280	
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	93,546.038	1,197,482,832	
	大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド （適格機関投資家専用）	98,589,319	99,693,519	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド （適格機関投資家専用）	843,901,075	1,252,517,975	
	L M ・ ウェスタン ・ グローバル債券ファンド （適格機関投資家専用）	1,679,291,490	2,021,363,166	
	F O F s 用世界ハイインカム入替戦略ファンド 為 替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	1,114,868,984	1,188,896,284	
	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リ ンクファンド（適格機関投資家専用）	2,767,712,891	2,979,996,469	
	F O F s 用世界物価連動債ファンド 為替ヘッ ジあり（適格機関投資家専用）	380,583,549	430,516,110	
マニユライフ F O F s 用日本債券ストラテジッ クファンド（適格機関投資家専用）	3,110,739,492	3,115,094,527		
投資信託受益証券合計		16,805,119,902.038	19,527,849,095	
投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	117,262.537	1,252,966,624	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	58,213	596,729,337	
投資証券合計		175,475.537	1,849,695,961	
親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	1,930,352,237	4,423,788,221	

グローバルREITインデックス マザーファンド	1,924,492,863	4,385,341,886	
国内株式インデックス マザーファンド	5,088,522,067	9,598,988,027	
外国株式インデックス マザーファンド	2,587,531,564	10,052,301,372	
外国債券インデックス マザーファンド	2,419,366,371	7,444,874,196	
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	3,864,539,915	1,475,094,885	
新興国債券インデックス マザーファンド	399,809,303	704,384,030	
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	3,329,169,406	4,209,401,796	
コモディティLSアルファ・マザーファンド	2,067,900,925	2,337,555,205	
米国株式LSマザーファンド	2,194,805,213	2,131,594,822	
日本債券ツイン戦略マザーファンド	3,148,854,615	3,144,131,333	
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	755,000,000	675,800,500	
親投資信託受益証券合計	29,710,344,479	50,583,256,273	
合計		71,960,801,329	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,036,524,443
株式	470,454,256,330
派生商品評価勘定	12,344,400
未収入金	45,360,000
未収配当金	577,542,549
差入委託証拠金	148,229,200
流動資産合計	474,274,256,922
資産合計	474,274,256,922
負債の部	

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	2,783,650
前受金	9,593,200
未払金	22,430,051
未払解約金	580,835,014
未払利息	4,633
流動負債合計	615,646,548
<b>負債合計</b>	615,646,548
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	251,095,419,520
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	222,563,190,854
元本等合計	473,658,610,374
純資産合計	473,658,610,374
負債純資産合計	474,274,256,922

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)



2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	251,095,419,520口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.8864円 (1万口当たり純資産額) (18,864円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2021年 7月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	217,285,082,423円
期中追加設定元本額	82,161,229,057円
期中一部解約元本額	48,350,891,960円
期末元本額	251,095,419,520円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	424,283,019円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,876,273,577円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,736,963円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,649,883,524円
世界経済インデックスファンド	2,822,073,484円
日本株式インデックス・オープン	3,539,191,471円

区分	2021年 7月12日現在
DCマイセレクション25	6,087,143,675円
DCマイセレクション50	18,004,570,102円
DCマイセレクション75	17,667,305,362円
DC日本株式インデックス・オープン	5,812,599,819円
DCマイセレクションS25	2,953,579,919円
DCマイセレクションS50	8,433,783,508円
DCマイセレクションS75	6,024,260,455円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,695,131,908円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	252,406,297円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	683,382,112円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	481,050,238円
DC世界経済インデックスファンド	3,246,862,263円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,547,256,898円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	6,195,294円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	26,725,162円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	20,457,639円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	197,410,242円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,358,345円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	48,505,703円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	169,859,479円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,037,864円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	96,601,348円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,147,888,465円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	480,637,604円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,052,300,259円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	224,991,134円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	28,726,222円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	551,680,127円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	317,581,585円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	398,555,983円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	41,816,544円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	646,457,353円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,796,671,426円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,961,744,624円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,492,806,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,088,522,067円
分散投資コア戦略ファンドA	2,004,794,091円
分散投資コア戦略ファンドS	7,145,826,516円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	418,281,188円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	392,521,843円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,042,957,008円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,246,216円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,357,359円

区分	2021年 7月12日現在
SMT インデックスバランス・オープン	59,761,332円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	24,692,828,613円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	604,397,930円
SMT 世界経済インデックス・オープン	35,074,403円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	118,270,617円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	21,455,096円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,106,757円
グローバル経済コア	235,284,349円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,575,482円
i-SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	62,537,046円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	18,037,076円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,178,861,159円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	134,932,760円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	4,291,324円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2,896,942円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,352,118円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,188,065円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,618,131,726円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,180,760,727円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	167,958,933円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	27,254,880円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,638,172,549円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		7,226,127,298
合計		7,226,127,298

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「国内株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,130,711,800	-	3,140,305,000	9,593,200

合計	3,130,711,800	-	3,140,305,000	9,593,200
----	---------------	---	---------------	-----------

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	7,700	2,912.00	22,422,400	
日本水産	221,300	537.00	118,838,100	
マルハニチロ	37,300	2,379.00	88,736,700	
雪国まいたけ	19,600	1,682.00	32,967,200	
カネコ種苗	7,200	1,467.00	10,562,400	
サカタのタネ	28,400	3,755.00	106,642,000	
ホクト	20,000	1,937.00	38,740,000	
ホクリヨウ	3,700	823.00	3,045,100	
住石ホールディングス	41,700	128.00	5,337,600	
日鉄鉱業	5,500	5,910.00	32,505,000	
三井松島ホールディングス	10,000	1,015.00	10,150,000	
I N P E X	876,600	813.00	712,675,800	
石油資源開発	31,100	1,912.00	59,463,200	
K & O エナジーグループ	11,600	1,319.00	15,300,400	
ヒノキヤグループ	5,900	2,383.00	14,059,700	
ショーボンドホールディングス	34,000	4,740.00	161,160,000	
ミライト・ホールディングス	82,600	2,073.00	171,229,800	
タマホーム	14,400	2,336.00	33,638,400	
サンヨーホームズ	2,800	721.00	2,018,800	
日本アクア	9,500	536.00	5,092,000	
ファーストコーポレーション	7,300	786.00	5,737,800	
ベステラ	4,600	1,470.00	6,762,000	
R o b o t H o m e	44,700	232.00	10,370,400	
キャンディル	4,100	582.00	2,386,200	
スペースバリューホールディングス	29,100	740.00	21,534,000	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	1,180.00	5,428,000	
第一カッター興業	5,900	1,350.00	7,965,000	
安藤・間	152,800	860.00	131,408,000	

東急建設	69,800	813.00	56,747,400
コムシスホールディングス	84,500	3,085.00	260,682,500
ビーアールホールディングス	31,900	477.00	15,216,300
高松コンストラクショングループ	14,800	2,049.00	30,325,200
東建コーポレーション	7,300	10,340.00	75,482,000
ソネック	2,500	1,016.00	2,540,000
ヤマウラ	10,400	911.00	9,474,400
オリエンタル白石	80,100	281.00	22,508,100
大成建設	171,300	3,790.00	649,227,000
大林組	550,500	914.00	503,157,000
清水建設	515,600	891.00	459,399,600
飛島建設	15,800	1,089.00	17,206,200
長谷工コーポレーション	180,300	1,506.00	271,531,800
松井建設	21,700	798.00	17,316,600
銭高組	2,400	4,065.00	9,756,000
鹿島建設	403,300	1,439.00	580,348,700
不動テトラ	13,500	1,850.00	24,975,000
大末建設	6,900	987.00	6,810,300
鉄建建設	11,100	1,894.00	21,023,400
西松建設	39,400	3,660.00	144,204,000
三井住友建設	133,000	492.00	65,436,000
大豊建設	12,100	4,275.00	51,727,500
前田建設工業	137,900	973.00	134,176,700
佐田建設	12,700	482.00	6,121,400
ナカノフドー建設	13,200	422.00	5,570,400
奥村組	30,300	2,979.00	90,263,700
東鉄工業	23,600	2,363.00	55,766,800
イチケン	4,000	1,868.00	7,472,000
富士ピー・エス	7,100	550.00	3,905,000
浅沼組	6,600	4,685.00	30,921,000
戸田建設	228,600	774.00	176,936,400
熊谷組	25,500	2,854.00	72,777,000
北野建設	3,400	2,333.00	7,932,200
植木組	4,900	1,456.00	7,134,400
矢作建設工業	24,300	731.00	17,763,300
ピーエス三菱	18,100	619.00	11,203,900
日本ハウスホールディングス	37,600	404.00	15,190,400
大東建託	60,100	13,060.00	784,906,000
新日本建設	23,400	859.00	20,100,600
N I P P O	45,500	3,140.00	142,870,000
東亜道路工業	3,400	4,635.00	15,759,000
前田道路	34,000	2,205.00	74,970,000

日本道路	5,300	8,000.00	42,400,000
東亜建設工業	14,700	2,497.00	36,705,900
日本国土開発	53,500	585.00	31,297,500
若築建設	9,900	1,672.00	16,552,800
東洋建設	61,700	580.00	35,786,000
五洋建設	233,800	772.00	180,493,600
世紀東急工業	26,400	873.00	23,047,200
福田組	6,400	4,940.00	31,616,000
住友林業	140,800	2,037.00	286,809,600
日本基礎技術	16,800	572.00	9,609,600
巴コーポレーション	24,400	381.00	9,296,400
大和ハウス工業	508,300	3,381.00	1,718,562,300
ライト工業	31,500	1,905.00	60,007,500
積水ハウス	597,000	2,293.00	1,368,921,000
日特建設	14,200	770.00	10,934,000
北陸電気工事	9,500	1,295.00	12,302,500
ユアテック	31,500	737.00	23,215,500
日本リーテック	11,500	1,685.00	19,377,500
四電工	3,000	3,005.00	9,015,000
中電工	25,300	2,301.00	58,215,300
関電工	89,500	895.00	80,102,500
きんでん	111,800	1,836.00	205,264,800
東京エネシス	18,300	959.00	17,549,700
トーエネック	5,500	3,785.00	20,817,500
住友電設	15,500	2,307.00	35,758,500
日本電設工業	30,200	1,936.00	58,467,200
協和エクシオ	83,500	2,747.00	229,374,500
新日本空調	14,600	2,112.00	30,835,200
九電工	38,600	3,645.00	140,697,000
三機工業	39,000	1,448.00	56,472,000
日揮ホールディングス	183,600	1,028.00	188,740,800
中外炉工業	6,000	1,933.00	11,598,000
ヤマト	17,600	816.00	14,361,600
太平電業	12,200	2,677.00	32,659,400
高砂熱学工業	49,800	1,918.00	95,516,400
三晃金属工業	2,200	2,375.00	5,225,000
朝日工業社	4,100	3,210.00	13,161,000
明星工業	35,600	745.00	26,522,000
大気社	26,800	3,415.00	91,522,000
ダイダン	12,200	2,618.00	31,939,600
日比谷総合設備	17,700	1,838.00	32,532,600
フィル・カンパニー	3,100	2,695.00	8,354,500

テスホールディングス	10,000	2,084.00	20,840,000
東洋エンジニアリング	23,100	722.00	16,678,200
レイズネクスト	29,500	1,181.00	34,839,500
ニッポン	51,500	1,582.00	81,473,000
日清製粉グループ本社	199,000	1,674.00	333,126,000
日東富士製粉	1,300	6,930.00	9,009,000
昭和産業	14,800	3,045.00	45,066,000
鳥越製粉	15,600	791.00	12,339,600
中部飼料	21,500	1,153.00	24,789,500
フィード・ワン	23,700	745.00	17,656,500
東洋精糖	3,000	1,198.00	3,594,000
日本甜菜製糖	9,200	1,659.00	15,262,800
D M三井製糖ホールディングス	13,900	1,864.00	25,909,600
塩水港精糖	21,000	222.00	4,662,000
日新製糖	8,300	1,703.00	14,134,900
森永製菓	41,300	3,675.00	151,777,500
中村屋	4,200	3,840.00	16,128,000
江崎グリコ	48,500	4,215.00	204,427,500
名糖産業	7,800	1,591.00	12,409,800
井村屋グループ	10,000	2,335.00	23,350,000
不二家	11,200	2,222.00	24,886,400
山崎製パン	132,000	1,551.00	204,732,000
第一屋製パン	3,400	939.00	3,192,600
モロゾフ	2,800	5,350.00	14,980,000
亀田製菓	10,000	4,595.00	45,950,000
寿スピリッツ	17,000	7,700.00	130,900,000
カルビー	80,300	2,578.00	207,013,400
森永乳業	32,600	5,980.00	194,948,000
六甲バター	11,700	1,533.00	17,936,100
ヤクルト本社	121,200	6,460.00	782,952,000
明治ホールディングス	116,500	6,800.00	792,200,000
雪印メグミルク	42,400	2,092.00	88,700,800
プリマハム	24,800	2,976.00	73,804,800
日本ハム	67,300	4,325.00	291,072,500
林兼産業	5,800	582.00	3,375,600
丸大食品	17,300	1,729.00	29,911,700
S Foods	15,800	3,355.00	53,009,000
柿安本店	6,100	2,509.00	15,304,900
伊藤ハム米久ホールディングス	113,400	731.00	82,895,400
サッポロホールディングス	60,100	2,344.00	140,874,400
アサヒグループホールディングス	384,900	5,106.00	1,965,299,400
キリンホールディングス	747,100	2,111.50	1,577,501,650



宝ホールディングス	130,600	1,368.00	178,660,800
オエノンホールディングス	50,000	378.00	18,900,000
養命酒製造	5,400	1,823.00	9,844,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	134,900	1,749.00	235,940,100
サントリー食品インターナショナル	117,900	4,155.00	489,874,500
ダイドグループホールディングス	9,900	5,000.00	49,500,000
伊藤園	53,500	6,650.00	355,775,000
キーコーヒー	17,300	2,136.00	36,952,800
ユニカフェ	5,300	996.00	5,278,800
ジャパンフーズ	2,500	1,225.00	3,062,500
日清オイリオグループ	22,200	3,060.00	67,932,000
不二製油グループ本社	42,900	2,540.00	108,966,000
かどや製油	1,900	4,080.00	7,752,000
J - オイルミルズ	16,400	1,863.00	30,553,200
キッコーマン	126,800	7,110.00	901,548,000
味の素	419,000	2,879.50	1,206,510,500
ブルドックソース	8,000	2,355.00	18,840,000
キューピー	98,100	2,486.00	243,876,600
ハウス食品グループ本社	65,900	3,450.00	227,355,000
カゴメ	72,000	2,899.00	208,728,000
焼津水産化学工業	8,500	964.00	8,194,000
アリアケジャパン	16,100	7,030.00	113,183,000
ピエトロ	2,300	1,721.00	3,958,300
エバラ食品工業	3,900	2,634.00	10,272,600
やまみ	1,900	1,921.00	3,649,900
ニチレイ	83,900	2,951.00	247,588,900
東洋水産	90,600	4,235.00	383,691,000
イトアンドホールディングス	6,100	1,955.00	11,925,500
大冷	2,000	2,004.00	4,008,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,900	742.00	7,345,800
日清食品ホールディングス	69,100	7,920.00	547,272,000
永谷園ホールディングス	8,600	2,169.00	18,653,400
一正蒲鉾	6,800	932.00	6,337,600
フジッコ	19,100	1,930.00	36,863,000
ロック・フィールド	19,000	1,523.00	28,937,000
日本たばこ産業	944,600	2,120.00	2,002,552,000
ケンコーマヨネーズ	10,800	1,548.00	16,718,400
わらべや日洋ホールディングス	11,500	2,380.00	27,370,000
なとり	9,800	1,941.00	19,021,800
イフジ産業	2,700	954.00	2,575,800
ピクルスコーポレーション	4,200	3,425.00	14,385,000
ファーマフーズ	16,600	2,960.00	49,136,000

北の達人コーポレーション	61,500	478.00	29,397,000
ユーグレナ	89,700	1,073.00	96,248,100
紀文食品	10,300	1,331.00	13,709,300
ミヨシ油脂	6,200	1,278.00	7,923,600
理研ビタミン	16,600	1,597.00	26,510,200
片倉工業	23,400	1,490.00	34,866,000
グンゼ	12,700	4,670.00	59,309,000
東洋紡	68,300	1,319.00	90,087,700
ユニチカ	51,700	336.00	17,371,200
富士紡ホールディングス	8,400	3,870.00	32,508,000
倉敷紡績	15,900	1,958.00	31,132,200
シキボウ	9,700	942.00	9,137,400
日本毛織	57,100	981.00	56,015,100
トーア紡コーポレーション	6,800	444.00	3,019,200
帝国繊維	19,600	2,115.00	41,454,000
帝人	162,100	1,649.00	267,302,900
東レ	1,245,400	723.00	900,424,200
サカイオーベックス	4,700	3,100.00	14,570,000
住江織物	3,800	2,039.00	7,748,200
日本フェルト	10,800	442.00	4,773,600
イチカワ	2,600	1,346.00	3,499,600
日東製網	1,800	1,524.00	2,743,200
アツギ	13,600	622.00	8,459,200
ダイニック	6,500	754.00	4,901,000
セーレン	42,500	2,163.00	91,927,500
ソトー	7,100	804.00	5,708,400
東海染工	2,400	1,138.00	2,731,200
小松マテーレ	28,500	929.00	26,476,500
ワコールホールディングス	43,000	2,544.00	109,392,000
ホギメディカル	23,200	3,455.00	80,156,000
T S Iホールディングス	52,800	379.00	20,011,200
マツオカコーポレーション	5,600	1,658.00	9,284,800
ワールド	22,600	1,463.00	33,063,800
三陽商会	8,900	1,061.00	9,442,900
ナイガイ	6,900	343.00	2,366,700
オンワードホールディングス	103,900	352.00	36,572,800
ルックホールディングス	6,000	1,440.00	8,640,000
ゴールドウイン	28,500	6,300.00	179,550,000
デサント	29,400	2,982.00	87,670,800
キング	9,600	483.00	4,636,800
ヤマトインターナショナル	15,700	341.00	5,353,700
特種東海製紙	10,600	4,525.00	47,965,000

王子ホールディングス	773,900	642.00	496,843,800
日本製紙	76,000	1,253.00	95,228,000
三菱製紙	24,400	352.00	8,588,800
北越コーポレーション	123,000	600.00	73,800,000
中越パルプ工業	6,500	1,271.00	8,261,500
巴川製紙所	5,700	797.00	4,542,900
大王製紙	82,900	1,838.00	152,370,200
阿波製紙	4,400	402.00	1,768,800
レンゴー	177,300	916.00	162,406,800
トモク	10,500	1,937.00	20,338,500
ザ・パック	13,000	2,754.00	35,802,000
クラレ	270,700	1,018.00	275,572,600
旭化成	1,139,400	1,210.50	1,379,243,700
共和レザー	9,300	716.00	6,658,800
昭和電工	130,500	3,265.00	426,082,500
住友化学	1,353,200	571.00	772,677,200
住友精化	8,400	3,680.00	30,912,000
日産化学	94,200	5,350.00	503,970,000
ラサ工業	5,600	1,846.00	10,337,600
クレハ	14,700	6,650.00	97,755,000
多木化学	6,700	5,210.00	34,907,000
テイカ	12,600	1,310.00	16,506,000
石原産業	30,800	1,115.00	34,342,000
片倉コープアグリ	4,400	1,214.00	5,341,600
日本曹達	24,000	3,240.00	77,760,000
東ソー	265,700	1,995.00	530,071,500
トクヤマ	51,100	2,266.00	115,792,600
セントラル硝子	32,800	2,157.00	70,749,600
東亜合成	104,900	1,153.00	120,949,700
大阪ソーダ	17,500	2,424.00	42,420,000
関東電化工業	40,800	1,007.00	41,085,600
デンカ	62,700	3,700.00	231,990,000
信越化学工業	317,900	18,310.00	5,820,749,000
日本カーバイド工業	6,300	1,291.00	8,133,300
堺化学工業	12,000	1,871.00	22,452,000
第一稀元素化学工業	17,300	1,793.00	31,018,900
エア・ウォーター	175,300	1,659.00	290,822,700
日本酸素ホールディングス	141,600	2,359.00	334,034,400
日本化学工業	4,900	3,135.00	15,361,500
東邦アセチレン	2,600	1,187.00	3,086,200
日本パーカライズン	86,700	1,136.00	98,491,200
高圧ガス工業	27,300	676.00	18,454,800

チタン工業	2,100	1,858.00	3,901,800
四国化成工業	22,800	1,319.00	30,073,200
戸田工業	3,700	2,649.00	9,801,300
ステラ ケミファ	9,400	2,839.00	26,686,600
保土谷化学工業	5,000	3,955.00	19,775,000
日本触媒	31,100	5,280.00	164,208,000
大日精化工業	14,200	2,325.00	33,015,000
カネカ	44,500	4,530.00	201,585,000
三菱瓦斯化学	172,200	2,341.00	403,120,200
三井化学	148,400	3,680.00	546,112,000
J S R	172,500	3,565.00	614,962,500
東京応化工業	29,500	7,170.00	211,515,000
大阪有機化学工業	15,900	3,730.00	59,307,000
三菱ケミカルホールディングス	1,149,200	942.30	1,082,891,160
K Hネオケム	28,300	2,556.00	72,334,800
ダイセル	231,100	928.00	214,460,800
住友ベークライト	27,000	4,895.00	132,165,000
積水化学工業	359,800	1,918.00	690,096,400
日本ゼオン	155,000	1,482.00	229,710,000
アイカ工業	47,900	3,915.00	187,528,500
宇部興産	86,800	2,237.00	194,171,600
積水樹脂	28,100	2,148.00	60,358,800
タキロンシーアイ	37,200	602.00	22,394,400
旭有機材	9,700	1,356.00	13,153,200
ニチバン	9,000	1,775.00	15,975,000
リケンテクノス	41,900	589.00	24,679,100
大倉工業	8,100	2,442.00	19,780,200
積水化成品工業	23,000	610.00	14,030,000
群栄化学工業	3,900	2,491.00	9,714,900
タイガースポリマー	9,000	479.00	4,311,000
ミライアル	5,500	1,283.00	7,056,500
ダイキアクシス	6,600	841.00	5,550,600
ダイキョーニシカワ	36,200	700.00	25,340,000
竹本容器	6,100	993.00	6,057,300
森六ホールディングス	9,200	2,294.00	21,104,800
恵和	3,400	3,485.00	11,849,000
日本化薬	106,400	1,093.00	116,295,200
カーリットホールディングス	17,000	746.00	12,682,000
日本精化	12,400	1,607.00	19,926,800
扶桑化学工業	13,500	4,255.00	57,442,500
トリケミカル研究所	15,900	3,140.00	49,926,000
A D E K A	79,100	2,123.00	167,929,300

日油	64,700	5,780.00	373,966,000
新日本理化	28,400	269.00	7,639,600
ハリマ化成グループ	12,800	885.00	11,328,000
花王	420,300	6,802.00	2,858,880,600
第一工業製薬	5,800	3,220.00	18,676,000
石原ケミカル	4,300	2,154.00	9,262,200
日華化学	5,800	1,329.00	7,708,200
ニイタカ	3,600	2,091.00	7,527,600
三洋化成工業	10,300	5,370.00	55,311,000
有機合成薬品工業	13,200	386.00	5,095,200
大日本塗料	19,400	857.00	16,625,800
日本ペイントホールディングス	709,200	1,381.00	979,405,200
関西ペイント	193,100	2,783.00	537,397,300
神東塗料	13,500	193.00	2,605,500
中国塗料	41,400	872.00	36,100,800
日本特殊塗料	12,900	1,110.00	14,319,000
藤倉化成	23,200	515.00	11,948,000
太陽ホールディングス	12,600	5,120.00	64,512,000
D I C	72,600	2,763.00	200,593,800
サカタインクス	37,500	1,020.00	38,250,000
東洋インキSCホールディングス	36,300	1,965.00	71,329,500
T & K T O K A	12,000	853.00	10,236,000
富士フイルムホールディングス	308,500	8,190.00	2,526,615,000
資生堂	348,800	8,000.00	2,790,400,000
ライオン	228,200	1,973.00	450,238,600
高砂香料工業	11,000	2,708.00	29,788,000
マンダム	36,800	1,989.00	73,195,200
ミルボン	23,500	6,180.00	145,230,000
ファンケル	63,900	3,570.00	228,123,000
コーセー	33,000	17,580.00	580,140,000
コタ	11,100	1,414.00	15,695,400
シーボン	2,300	1,978.00	4,549,400
ポーラ・オルビスホールディングス	74,900	2,878.00	215,562,200
ノエビアホールディングス	14,900	5,660.00	84,334,000
アジュバンコスメジャパン	3,900	1,036.00	4,040,400
新日本製薬	4,800	2,085.00	10,008,000
エステー	11,300	1,721.00	19,447,300
アグロ カネショウ	6,600	1,409.00	9,299,400
コニシ	28,800	1,615.00	46,512,000
長谷川香料	30,300	2,514.00	76,174,200
星光P M C	10,100	935.00	9,443,500
小林製薬	49,200	9,390.00	461,988,000

荒川化学工業	14,600	1,190.00	17,374,000
メック	12,000	3,320.00	39,840,000
日本高純度化学	4,800	2,901.00	13,924,800
タカラバイオ	45,900	2,913.00	133,706,700
J C U	19,700	3,725.00	73,382,500
新田ゼラチン	11,000	635.00	6,985,000
O A Tアグリオ	3,300	1,401.00	4,623,300
デクセリアルズ	49,100	2,379.00	116,808,900
アース製薬	13,200	6,470.00	85,404,000
北興化学工業	16,300	1,075.00	17,522,500
大成ラミック	5,400	2,748.00	14,839,200
クミアイ化学工業	72,600	854.00	62,000,400
日本農薬	31,300	513.00	16,056,900
アキレス	12,100	1,388.00	16,794,800
有沢製作所	24,400	891.00	21,740,400
日東電工	106,100	8,290.00	879,569,000
レック	20,800	1,146.00	23,836,800
三光合成	18,400	443.00	8,151,200
きもと	26,900	280.00	7,532,000
藤森工業	15,800	4,190.00	66,202,000
前澤化成工業	11,100	1,262.00	14,008,200
未来工業	6,300	1,700.00	10,710,000
ウェーブロックホールディングス	6,100	697.00	4,251,700
J S P	10,300	1,648.00	16,974,400
エフピコ	32,300	4,110.00	132,753,000
天馬	13,200	2,629.00	34,702,800
信越ポリマー	27,000	1,046.00	28,242,000
東リ	43,700	241.00	10,531,700
ニフコ	64,400	3,945.00	254,058,000
バルカー	14,300	2,168.00	31,002,400
ユニ・チャーム	372,200	4,482.00	1,668,200,400
ショーエイコーポレーション	3,900	964.00	3,759,600
協和キリン	176,600	3,990.00	704,634,000
武田薬品工業	1,460,400	3,698.00	5,400,559,200
アステラス製薬	1,521,900	1,918.50	2,919,765,150
大日本住友製薬	130,100	2,215.00	288,171,500
塩野義製薬	220,700	5,824.00	1,285,356,800
わかもと製薬	20,900	329.00	6,876,100
日本新薬	49,800	8,770.00	436,746,000
バイオフェルミン製薬	3,000	2,993.00	8,979,000
中外製薬	549,000	4,238.00	2,326,662,000
科研製薬	30,000	4,795.00	143,850,000

エーザイ	193,900	10,530.00	2,041,767,000
ロート製薬	83,700	3,020.00	252,774,000
小野薬品工業	403,100	2,524.50	1,017,625,950
久光製薬	51,100	5,390.00	275,429,000
持田製薬	24,400	3,725.00	90,890,000
参天製薬	305,500	1,541.00	470,775,500
扶桑薬品工業	5,700	2,237.00	12,750,900
日本ケミファ	2,100	2,249.00	4,722,900
ツムラ	58,600	3,470.00	203,342,000
日医工	49,700	862.00	42,841,400
キッセイ薬品工業	31,100	2,219.00	69,010,900
生化学工業	31,000	1,111.00	34,441,000
栄研化学	30,800	2,170.00	66,836,000
日水製薬	6,500	1,006.00	6,539,000
鳥居薬品	11,000	2,444.00	26,884,000
JCRファーマ	49,500	3,660.00	181,170,000
東和薬品	25,300	2,549.00	64,489,700
富士製薬工業	10,800	1,144.00	12,355,200
ゼリア新薬工業	31,800	2,083.00	66,239,400
第一三共	1,379,400	2,309.00	3,185,034,600
キョーリン製薬ホールディングス	38,700	1,804.00	69,814,800
大幸薬品	21,600	965.00	20,844,000
ダイト	11,200	3,465.00	38,808,000
大塚ホールディングス	364,800	4,390.00	1,601,472,000
大正製薬ホールディングス	41,800	6,020.00	251,636,000
ペプチドリーム	92,100	4,910.00	452,211,000
あすか製薬ホールディングス	20,000	965.00	19,300,000
サワイグループホールディングス	38,400	4,730.00	181,632,000
日本コークス工業	148,300	101.00	14,978,300
ニチレキ	20,700	1,351.00	27,965,700
ユシロ化学工業	9,800	1,195.00	11,711,000
ビーピー・カストロール	6,300	1,343.00	8,460,900
富士石油	42,600	261.00	11,118,600
MORESCO	6,300	1,091.00	6,873,300
出光興産	194,800	2,622.00	510,765,600
ENEOSホールディングス	2,640,500	470.50	1,242,355,250
コスモエネルギーホールディングス	55,400	2,542.00	140,826,800
横浜ゴム	101,600	2,285.00	232,156,000
TOYO TIRE	92,400	2,225.00	205,590,000
ブリヂストン	466,700	4,960.00	2,314,832,000
住友ゴム工業	157,700	1,500.00	236,550,000
藤倉コンポジット	15,300	488.00	7,466,400

オカモト	10,600	4,165.00	44,149,000
フコク	7,700	930.00	7,161,000
ニッタ	18,100	2,700.00	48,870,000
住友理工	34,000	724.00	24,616,000
三ツ星ベルト	21,300	1,827.00	38,915,100
バンドー化学	30,900	919.00	28,397,100
日東紡績	26,200	3,210.00	84,102,000
A G C	161,200	4,665.00	751,998,000
日本板硝子	89,100	606.00	53,994,600
石塚硝子	3,000	1,877.00	5,631,000
日本山村硝子	7,400	920.00	6,808,000
日本電気硝子	65,100	2,509.00	163,335,900
オハラ	7,000	1,444.00	10,108,000
住友大阪セメント	31,600	3,000.00	94,800,000
太平洋セメント	99,800	2,487.00	248,202,600
日本ヒューム	16,100	733.00	11,801,300
日本コンクリート工業	38,100	318.00	12,115,800
三谷セキサン	8,200	4,345.00	35,629,000
アジアパイルホールディングス	27,200	455.00	12,376,000
東海カーボン	171,700	1,498.00	257,206,600
日本カーボン	9,700	4,095.00	39,721,500
東洋炭素	10,300	2,781.00	28,644,300
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	4,295.00	41,661,500
T O T O	125,400	5,790.00	726,066,000
日本碍子	193,200	1,848.00	357,033,600
日本特殊陶業	133,600	1,618.00	216,164,800
M A R U W A	6,100	11,050.00	67,405,000
品川リフラクトリーズ	4,100	3,965.00	16,256,500
黒崎播磨	3,000	4,795.00	14,385,000
ヨータイ	12,600	1,330.00	16,758,000
イソライト工業	7,900	682.00	5,387,800
東京窯業	22,700	319.00	7,241,300
ニッカトー	8,100	687.00	5,564,700
フジインコーポレーテッド	14,100	4,845.00	68,314,500
クニミネ工業	5,600	1,184.00	6,630,400
エーアンドエーマテリアル	3,400	1,013.00	3,444,200
ニチアス	44,400	2,816.00	125,030,400
ニチハ	24,400	2,900.00	70,760,000
日本製鉄	828,700	1,828.50	1,515,277,950
神戸製鋼所	317,800	704.00	223,731,200
中山製鋼所	24,300	396.00	9,622,800
合同製鐵	9,400	1,634.00	15,359,600



ジェイ エフ イー ホールディングス	502,300	1,292.00	648,971,600
東京製鐵	67,700	1,070.00	72,439,000
共英製鋼	19,600	1,402.00	27,479,200
大和工業	36,900	3,600.00	132,840,000
東京鐵鋼	6,700	1,581.00	10,592,700
大阪製鐵	9,300	1,114.00	10,360,200
淀川製鋼所	22,800	2,332.00	53,169,600
丸一鋼管	56,400	2,660.00	150,024,000
モリ工業	5,200	2,328.00	12,105,600
大同特殊鋼	28,400	5,330.00	151,372,000
日本高周波鋼業	6,600	385.00	2,541,000
日本冶金工業	13,600	2,280.00	31,008,000
山陽特殊製鋼	20,800	1,577.00	32,801,600
愛知製鋼	9,800	3,060.00	29,988,000
日立金属	163,700	2,130.00	348,681,000
日本金属	4,400	952.00	4,188,800
大平洋金属	11,800	1,681.00	19,835,800
新日本電工	112,300	300.00	33,690,000
栗本鐵工所	7,900	1,690.00	13,351,000
虹技	2,500	1,111.00	2,777,500
三菱製鋼	12,900	1,097.00	14,151,300
日亜鋼業	25,700	291.00	7,478,700
日本精線	2,500	4,530.00	11,325,000
エンビプロ・ホールディングス	7,400	1,240.00	9,176,000
シンニッタン	21,300	250.00	5,325,000
新家工業	4,300	1,587.00	6,824,100
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,146.00	30,139,800
日本軽金属ホールディングス	47,400	1,877.00	88,969,800
三井金属鉱業	46,900	3,050.00	143,045,000
東邦亜鉛	9,700	1,875.00	18,187,500
三菱マテリアル	114,700	2,246.00	257,616,200
住友金属鉱山	221,900	4,405.00	977,469,500
D O W Aホールディングス	43,900	4,280.00	187,892,000
古河機械金属	28,800	1,257.00	36,201,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,200	780.00	14,196,000
東邦チタニウム	31,200	1,021.00	31,855,200
U A C J	26,400	2,872.00	75,820,800
C Kサンエツ	3,700	3,035.00	11,229,500
古河電気工業	54,000	2,766.00	149,364,000
住友電気工業	605,800	1,595.50	966,553,900
フジクラ	209,900	560.00	117,544,000
昭和電線ホールディングス	16,900	1,824.00	30,825,600

東京特殊電線	2,300	2,597.00	5,973,100
タツタ電線	30,800	557.00	17,155,600
カナレ電気	3,000	1,677.00	5,031,000
平河ヒューテック	9,700	1,205.00	11,688,500
リョービ	21,400	1,521.00	32,549,400
アーレスティ	21,600	485.00	10,476,000
アサヒホールディングス	65,200	2,265.00	147,678,000
稲葉製作所	9,800	1,536.00	15,052,800
宮地エンジニアリンググループ	5,700	2,456.00	13,999,200
トーカロ	44,800	1,416.00	63,436,800
アルファC o	6,100	1,135.00	6,923,500
SUMCO	221,400	2,713.00	600,658,200
川田テクノロジーズ	3,500	3,725.00	13,037,500
RS Technologies	5,600	6,250.00	35,000,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	3,270.00	6,213,000
信和	9,200	706.00	6,495,200
東洋製罐グループホールディングス	110,600	1,427.00	157,826,200
ホッカンホールディングス	8,800	1,413.00	12,434,400
コロナ	9,600	930.00	8,928,000
横河ブリッジホールディングス	29,800	2,079.00	61,954,200
駒井ハルテック	3,500	1,699.00	5,946,500
高田機工	1,600	2,734.00	4,374,400
三和ホールディングス	163,600	1,348.00	220,532,800
文化シャッター	51,100	1,171.00	59,838,100
三協立山	22,400	865.00	19,376,000
アルインコ	11,500	1,023.00	11,764,500
東洋シャッター	3,800	639.00	2,428,200
LIXIL	239,000	2,954.00	706,006,000
日本フィルコン	12,100	519.00	6,279,900
ノーリツ	36,000	1,859.00	66,924,000
長府製作所	17,600	2,048.00	36,044,800
リンナイ	33,800	10,530.00	355,914,000
ダイニチ工業	8,300	758.00	6,291,400
日東精工	21,800	595.00	12,971,000
三洋工業	2,100	1,897.00	3,983,700
岡部	35,200	658.00	23,161,600
ジーテクト	21,500	1,544.00	33,196,000
東ブレ	32,400	1,566.00	50,738,400
高周波熱錬	33,400	577.00	19,271,800
東京製綱	12,400	1,117.00	13,850,800
サンコール	14,800	455.00	6,734,000
モリテック スチール	13,500	476.00	6,426,000

パイオラックス	25,700	1,515.00	38,935,500
エイチワン	17,000	747.00	12,699,000
日本発條	172,900	863.00	149,212,700
中央発條	8,400	1,406.00	11,810,400
アドバネクス	2,500	1,283.00	3,207,500
立川ブラインド工業	7,600	1,332.00	10,123,200
三益半導体工業	13,500	2,584.00	34,884,000
日本ドライケミカル	4,400	1,800.00	7,920,000
日本製鋼所	52,800	2,809.00	148,315,200
三浦工業	75,200	4,965.00	373,368,000
タクマ	58,900	1,714.00	100,954,600
ツガミ	36,100	1,658.00	59,853,800
オークマ	20,300	5,480.00	111,244,000
芝浦機械	18,100	2,569.00	46,498,900
アマダ	254,600	1,141.00	290,498,600
アイダエンジニアリング	45,700	966.00	44,146,200
滝澤鉄工所	5,100	1,123.00	5,727,300
F U J I	69,300	2,577.00	178,586,100
牧野フライス製作所	20,400	4,400.00	89,760,000
オーエスジー	85,700	2,067.00	177,141,900
ダイジェット工業	2,100	1,313.00	2,757,300
旭ダイヤモンド工業	46,000	523.00	24,058,000
D M G 森精機	110,000	1,848.00	203,280,000
ソディック	41,800	1,032.00	43,137,600
ディスコ	23,600	33,250.00	784,700,000
日東工器	8,400	1,878.00	15,775,200
日進工具	13,700	1,468.00	20,111,600
パンチ工業	14,600	630.00	9,198,000
富士ダイス	8,900	669.00	5,954,100
豊和工業	9,900	820.00	8,118,000
O K K	6,700	440.00	2,948,000
東洋機械金属	12,600	509.00	6,413,400
津田駒工業	3,300	881.00	2,907,300
エンシュウ	4,400	862.00	3,792,800
島精機製作所	25,500	1,915.00	48,832,500
オプトラン	21,800	2,412.00	52,581,600
N C ホールディングス	5,300	1,235.00	6,545,500
イワキポンプ	11,100	913.00	10,134,300
フリーー	17,000	1,376.00	23,392,000
ヤマシンフィルタ	35,100	727.00	25,517,700
日阪製作所	21,500	832.00	17,888,000
やまびこ	33,700	1,238.00	41,720,600

平田機工	8,200	6,510.00	53,382,000
ペガサスミシン製造	17,800	478.00	8,508,400
マルマエ	7,200	2,142.00	15,422,400
タツモ	7,400	1,727.00	12,779,800
ナブテスコ	102,300	4,215.00	431,194,500
三井海洋開発	18,500	1,978.00	36,593,000
レオン自動機	17,100	1,387.00	23,717,700
S M C	51,400	67,860.00	3,488,004,000
ホソカワミクロン	6,100	6,190.00	37,759,000
ユニオンツール	6,500	4,080.00	26,520,000
オイレス工業	24,400	1,607.00	39,210,800
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,830.00	28,497,000
サトーホールディングス	22,900	2,725.00	62,402,500
技研製作所	15,300	4,860.00	74,358,000
日本エアータック	5,800	1,260.00	7,308,000
カワタ	4,800	882.00	4,233,600
日精樹脂工業	13,500	1,374.00	18,549,000
オカダアイヨン	5,600	1,339.00	7,498,400
ワイエイシイホールディングス	6,900	1,105.00	7,624,500
小松製作所	795,400	2,731.50	2,172,635,100
住友重機械工業	100,500	3,115.00	313,057,500
日立建機	82,100	3,305.00	271,340,500
日工	26,500	692.00	18,338,000
巴工業	6,900	2,290.00	15,801,000
井関農機	17,700	1,480.00	26,196,000
T O W A	16,400	2,258.00	37,031,200
丸山製作所	3,700	1,774.00	6,563,800
北川鉄工所	8,000	1,672.00	13,376,000
ローツェ	7,700	9,600.00	73,920,000
タカキタ	6,300	612.00	3,855,600
クボタ	922,200	2,272.50	2,095,699,500
荏原実業	8,900	2,843.00	25,302,700
三菱化工機	5,700	2,532.00	14,432,400
月島機械	32,500	1,194.00	38,805,000
帝国電機製作所	12,300	1,245.00	15,313,500
新東工業	41,900	803.00	33,645,700
澁谷工業	15,400	3,180.00	48,972,000
アイチ コーポレーション	30,100	855.00	25,735,500
小森コーポレーション	44,800	824.00	36,915,200
鶴見製作所	13,600	1,715.00	23,324,000
住友精密工業	2,600	2,910.00	7,566,000
日本ギア工業	7,300	322.00	2,350,600

酒井重工業	3,200	2,653.00	8,489,600	
荏原製作所	72,900	5,450.00	397,305,000	
石井鐵工所	2,600	3,050.00	7,930,000	
西島製作所	17,800	875.00	15,575,000	
北越工業	18,200	1,085.00	19,747,000	
ダイキン工業	223,600	22,025.00	4,924,790,000	
オルガノ	5,700	6,100.00	34,770,000	
トーヨーカネツ	6,700	2,435.00	16,314,500	
栗田工業	95,000	5,550.00	527,250,000	
椿本チエイン	25,100	3,270.00	82,077,000	
大同工業	8,500	1,123.00	9,545,500	
木村化工機	14,900	863.00	12,858,700	
アネスト岩田	29,700	1,050.00	31,185,000	
ダイフク	96,600	10,000.00	966,000,000	
サムコ	4,400	3,240.00	14,256,000	
加藤製作所	9,800	993.00	9,731,400	
油研工業	3,100	1,756.00	5,443,600	
タダノ	84,900	1,151.00	97,719,900	
フジテック	60,500	2,474.00	149,677,000	
C K D	40,800	2,306.00	94,084,800	
キトー	14,800	1,682.00	24,893,600	
平和	49,000	2,018.00	98,882,000	
理想科学工業	12,900	1,759.00	22,691,100	
S A N K Y O	41,800	2,878.00	120,300,400	
日本金銭機械	19,600	618.00	12,112,800	
マースグループホールディングス	11,200	1,624.00	18,188,800	
フクシマガリレイ	12,000	4,485.00	53,820,000	
オーイズミ	7,600	386.00	2,933,600	
ダイコク電機	8,200	921.00	7,552,200	
竹内製作所	29,400	2,904.00	85,377,600	
アマノ	46,000	2,866.00	131,836,000	
J U K I	24,400	797.00	19,446,800	
蛇の目ミシン工業	16,100	753.00	12,123,300	
マックス	23,600	1,837.00	43,353,200	
グローリー	45,100	2,374.00	107,067,400	
新晃工業	16,400	1,934.00	31,717,600	
大和冷機工業	28,300	1,066.00	30,167,800	
セガサミーホールディングス	159,700	1,494.00	238,591,800	
日本ピストンリング	6,500	1,284.00	8,346,000	
リケン	8,200	2,603.00	21,344,600	
T P R	23,700	1,499.00	35,526,300	
ツバキ・ナカシマ	33,900	1,698.00	57,562,200	

ホシザキ	55,300	9,420.00	520,926,000
大豊工業	14,400	941.00	13,550,400
日本精工	360,600	917.00	330,670,200
NTN	406,200	292.00	118,610,400
ジェイテクト	168,500	1,147.00	193,269,500
不二越	16,300	4,320.00	70,416,000
日本トムソン	48,200	662.00	31,908,400
THK	109,500	3,425.00	375,037,500
ユーシン精機	11,800	829.00	9,782,200
前澤給装工業	12,300	1,063.00	13,074,900
イーグル工業	21,800	1,124.00	24,503,200
前澤工業	10,700	692.00	7,404,400
日本ピラー工業	17,800	2,293.00	40,815,400
キッツ	54,300	774.00	42,028,200
マキタ	228,900	5,500.00	1,258,950,000
日立造船	139,500	792.00	110,484,000
三菱重工業	275,800	3,236.00	892,488,800
IHI	118,100	2,551.00	301,273,100
スター精密	27,100	1,698.00	46,015,800
日清紡ホールディングス	107,400	944.00	101,385,600
イビデン	84,600	6,070.00	513,522,000
コニカミノルタ	357,900	612.00	219,034,800
ブラザー工業	214,800	2,246.00	482,440,800
ミネベアミツミ	302,900	3,125.00	946,562,500
日立製作所	843,900	6,729.00	5,678,603,100
東芝	347,400	4,935.00	1,714,419,000
三菱電機	1,755,300	1,484.50	2,605,742,850
富士電機	105,800	5,230.00	553,334,000
東洋電機製造	7,000	1,157.00	8,099,000
安川電機	189,000	5,760.00	1,088,640,000
シンフォニアテクノロジー	22,800	1,282.00	29,229,600
明電舎	29,800	2,241.00	66,781,800
オリジン	4,900	1,344.00	6,585,600
山洋電気	8,600	7,760.00	66,736,000
デンヨー	15,000	2,005.00	30,075,000
東芝テック	18,900	4,650.00	87,885,000
芝浦メカトロニクス	3,200	7,880.00	25,216,000
マブチモーター	48,800	4,225.00	206,180,000
日本電産	422,500	13,115.00	5,541,087,500
トレックス・セミコンダクター	9,800	3,000.00	29,400,000
東光高岳	9,700	1,353.00	13,124,100
ダイヘン	19,200	4,800.00	92,160,000

ヤーマン	29,400	1,350.00	39,690,000
JVCケンウッド	156,400	235.00	36,754,000
ミマキエンジニアリング	17,100	788.00	13,474,800
I - P E X	8,600	2,384.00	20,502,400
日新電機	41,200	1,364.00	56,196,800
大崎電気工業	35,100	629.00	22,077,900
オムロン	146,100	9,370.00	1,368,957,000
日東工業	25,800	1,882.00	48,555,600
I D E C	23,600	2,253.00	53,170,800
正興電機製作所	6,100	1,741.00	10,620,100
不二電機工業	3,700	1,290.00	4,773,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	63,500	2,803.00	177,990,500
サクサホールディングス	4,200	1,338.00	5,619,600
メルコホールディングス	6,300	5,650.00	35,595,000
テクノメディカ	4,600	1,611.00	7,410,600
日本電気	223,100	5,660.00	1,262,746,000
富士通	157,900	21,165.00	3,341,953,500
沖電気工業	71,400	1,024.00	73,113,600
岩崎通信機	7,700	942.00	7,253,400
電気興業	8,500	2,253.00	19,150,500
サンケン電気	20,500	5,490.00	112,545,000
ナカヨ	3,500	1,430.00	5,005,000
アイホン	10,000	2,041.00	20,410,000
ルネサスエレクトロニクス	841,700	1,213.00	1,020,982,100
セイコーエプソン	217,800	1,957.00	426,234,600
ワコム	128,600	710.00	91,306,000
アルバック	32,300	5,600.00	180,880,000
アクセル	8,500	882.00	7,497,000
E I Z O	14,900	4,935.00	73,531,500
日本信号	41,100	926.00	38,058,600
京三製作所	38,000	424.00	16,112,000
能美防災	23,700	2,126.00	50,386,200
ホーチキ	13,600	1,178.00	16,020,800
星和電機	10,700	515.00	5,510,500
エレコム	40,700	2,086.00	84,900,200
パナソニック	1,872,000	1,327.50	2,485,080,000
シャープ	233,500	1,785.00	416,797,500
アンリツ	105,600	2,048.00	216,268,800
富士通ゼネラル	53,600	2,924.00	156,726,400
ソニーグループ	1,099,600	11,485.00	12,628,906,000
T D K	84,800	13,500.00	1,144,800,000
帝国通信工業	8,700	1,123.00	9,770,100

タムラ製作所	63,300	956.00	60,514,800
アルプスアルパイン	144,300	1,151.00	166,089,300
池上通信機	5,600	835.00	4,676,000
鈴木	9,000	950.00	8,550,000
日本トリム	4,100	3,800.00	15,580,000
ローランド ディー・ジー・	10,700	2,708.00	28,975,600
フォスター電機	17,800	949.00	16,892,200
S M K	4,500	2,450.00	11,025,000
ヨコオ	14,200	2,554.00	36,266,800
ホシデン	48,600	1,025.00	49,815,000
ヒロセ電機	27,100	16,580.00	449,318,000
日本航空電子工業	40,300	1,844.00	74,313,200
T O A	20,800	857.00	17,825,600
マクセルホールディングス	35,700	1,282.00	45,767,400
古野電気	23,700	1,031.00	24,434,700
ユニデンホールディングス	4,500	2,592.00	11,664,000
スミダコーポレーション	15,800	1,224.00	19,339,200
アイコム	7,300	2,404.00	17,549,200
リオン	7,800	2,762.00	21,543,600
本多通信工業	15,800	486.00	7,678,800
横河電機	175,700	1,668.00	293,067,600
新電元工業	6,800	4,490.00	30,532,000
アズビル	118,700	4,580.00	543,646,000
東亜ディーケーケー	10,000	813.00	8,130,000
日本光電工業	72,900	3,335.00	243,121,500
チノー	5,600	1,492.00	8,355,200
共和電業	18,700	385.00	7,199,500
日本電子材料	7,300	1,796.00	13,110,800
堀場製作所	34,800	7,170.00	249,516,000
アドバンテスト	130,500	9,680.00	1,263,240,000
小野測器	9,200	581.00	5,345,200
エスペック	16,000	2,236.00	35,776,000
キーエンス	172,300	58,470.00	10,074,381,000
日置電機	8,600	7,120.00	61,232,000
シスメックス	137,100	13,100.00	1,796,010,000
日本マイクロニクス	31,300	1,444.00	45,197,200
メガチップス	17,900	3,325.00	59,517,500
O B A R A G R O U P	8,200	3,930.00	32,226,000
澤藤電機	2,400	2,146.00	5,150,400
原田工業	8,300	911.00	7,561,300
コーセル	22,400	1,024.00	22,937,600
イリソ電子工業	14,900	5,320.00	79,268,000



オブテックスグループ	29,400	1,810.00	53,214,000
千代田インテグレ	8,000	1,771.00	14,168,000
アイ・オー・データ機器	7,500	1,010.00	7,575,000
レーザーテック	77,100	22,230.00	1,713,933,000
スタンレー電気	123,200	3,120.00	384,384,000
岩崎電気	7,000	1,993.00	13,951,000
ウシオ電機	90,500	2,087.00	188,873,500
岡谷電機産業	15,400	375.00	5,775,000
ハリオス テクノ ホールディング	19,300	341.00	6,581,300
エノモト	5,500	1,732.00	9,526,000
日本セラミック	18,200	2,919.00	53,125,800
遠藤照明	10,300	729.00	7,508,700
古河電池	13,200	1,508.00	19,905,600
双信電機	10,500	543.00	5,701,500
山一電機	12,100	1,630.00	19,723,000
図研	11,700	3,405.00	39,838,500
日本電子	32,100	6,630.00	212,823,000
カシオ計算機	141,200	1,898.00	267,997,600
ファナック	154,000	27,535.00	4,240,390,000
日本シイエムケイ	40,300	422.00	17,006,600
エンプラス	8,200	3,495.00	28,659,000
大真空	6,200	3,740.00	23,188,000
ローム	73,100	10,220.00	747,082,000
浜松ホトニクス	126,100	6,660.00	839,826,000
三井ハイテック	17,400	6,160.00	107,184,000
新光電気工業	59,200	3,990.00	236,208,000
京セラ	267,700	6,833.00	1,829,194,100
太陽誘電	78,200	5,500.00	430,100,000
村田製作所	515,700	9,113.00	4,699,574,100
双葉電子工業	31,400	791.00	24,837,400
北陸電気工業	7,600	1,030.00	7,828,000
ニチコン	56,100	1,182.00	66,310,200
日本ケミコン	17,700	2,636.00	46,657,200
K O A	24,900	1,635.00	40,711,500
市光工業	27,800	693.00	19,265,400
小糸製作所	105,300	6,580.00	692,874,000
ミツバ	32,300	794.00	25,646,200
S C R E E Nホールディングス	30,500	10,310.00	314,455,000
キャノン電子	16,700	1,694.00	28,289,800
キャノン	872,300	2,505.00	2,185,111,500
リコー	446,600	1,226.00	547,531,600
象印マホービン	48,100	1,610.00	77,441,000

MUTOHホールディングス	2,900	1,600.00	4,640,000
東京エレクトロン	102,800	46,710.00	4,801,788,000
トヨタ紡織	51,200	2,238.00	114,585,600
芦森工業	3,400	1,188.00	4,039,200
ユニプレス	28,900	967.00	27,946,300
豊田自動織機	142,100	9,420.00	1,338,582,000
モリタホールディングス	28,200	1,624.00	45,796,800
三櫻工業	24,300	1,186.00	28,819,800
デンソー	386,500	7,519.00	2,906,093,500
東海理化電機製作所	46,300	1,754.00	81,210,200
三井E & Sホールディングス	67,900	530.00	35,987,000
川崎重工業	136,600	2,391.00	326,610,600
名村造船所	52,700	187.00	9,854,900
日本車輛製造	6,400	2,107.00	13,484,800
三菱ロジスネクスト	23,200	1,023.00	23,733,600
近畿車輛	3,000	1,188.00	3,564,000
日産自動車	2,070,100	586.00	1,213,078,600
いすゞ自動車	466,000	1,494.00	696,204,000
トヨタ自動車	1,778,200	9,815.00	17,453,033,000
日野自動車	219,200	967.00	211,966,400
三菱自動車工業	649,700	309.00	200,757,300
エフテック	12,300	839.00	10,319,700
レシップホールディングス	7,000	569.00	3,983,000
GMB	3,200	1,238.00	3,961,600
ファルテック	3,200	727.00	2,326,400
武蔵精密工業	39,200	2,366.00	92,747,200
日産車体	25,700	733.00	18,838,100
新明和工業	49,600	961.00	47,665,600
極東開発工業	30,300	1,571.00	47,601,300
トピー工業	14,500	1,282.00	18,589,000
ティラド	5,500	2,668.00	14,674,000
曙ブレーキ工業	96,300	172.00	16,563,600
タチエス	27,000	1,395.00	37,665,000
NOK	85,000	1,356.00	115,260,000
フタバ産業	44,100	531.00	23,417,100
KYB	19,700	3,745.00	73,776,500
大同メタル工業	36,400	597.00	21,730,800
プレス工業	87,200	358.00	31,217,600
ミクニ	22,600	310.00	7,006,000
太平洋工業	36,800	1,192.00	43,865,600
河西工業	23,900	397.00	9,488,300
アイシン	128,500	4,735.00	608,447,500

マツダ	550,900	1,061.00	584,504,900
今仙電機製作所	15,500	702.00	10,881,000
本田技研工業	1,382,000	3,565.00	4,926,830,000
スズキ	347,900	4,730.00	1,645,567,000
S U B A R U	503,000	2,149.00	1,080,947,000
安永	8,500	1,155.00	9,817,500
ヤマハ発動機	248,000	2,837.00	703,576,000
T B K	21,100	414.00	8,735,400
エクセディ	23,900	1,638.00	39,148,200
豊田合成	56,700	2,645.00	149,971,500
愛三工業	27,600	874.00	24,122,400
盟和産業	2,800	1,002.00	2,805,600
日本プラスト	14,900	705.00	10,504,500
ヨロズ	15,100	1,206.00	18,210,600
エフ・シー・シー	28,700	1,569.00	45,030,300
シマノ	65,700	28,460.00	1,869,822,000
テイ・エス テック	81,600	1,652.00	134,803,200
ジャムコ	10,300	1,101.00	11,340,300
テルモ	538,100	4,412.00	2,374,097,200
クリエートメディック	5,800	985.00	5,713,000
日機装	56,700	1,145.00	64,921,500
日本エム・ディ・エム	10,100	2,252.00	22,745,200
島津製作所	225,900	4,400.00	993,960,000
J M S	14,900	813.00	12,113,700
長野計器	12,800	1,052.00	13,465,600
ブイ・テクノロジー	8,200	5,150.00	42,230,000
東京計器	11,200	1,068.00	11,961,600
愛知時計電機	2,300	4,305.00	9,901,500
インターアクション	8,800	2,473.00	21,762,400
オーバル	15,800	289.00	4,566,200
東京精密	29,600	4,950.00	146,520,000
マニー	69,900	2,591.00	181,110,900
ニコン	268,100	1,096.00	293,837,600
トプコン	88,400	1,627.00	143,826,800
オリンパス	971,200	2,226.00	2,161,891,200
理研計器	15,500	2,743.00	42,516,500
タムロン	14,200	2,457.00	34,889,400
H O Y A	342,500	15,030.00	5,147,775,000
シード	6,900	774.00	5,340,600
ノーリツ鋼機	15,800	2,554.00	40,353,200
エー・アンド・デイ	14,800	991.00	14,666,800
朝日インテック	186,000	2,835.00	527,310,000

シチズン時計	222,800	417.00	92,907,600
リズム	5,500	777.00	4,273,500
大研医器	14,000	551.00	7,714,000
メニコン	27,000	7,840.00	211,680,000
シンシア	1,900	608.00	1,155,200
松風	8,100	2,050.00	16,605,000
セイコーホールディングス	24,800	2,403.00	59,594,400
ニプロ	130,800	1,363.00	178,280,400
中本パックス	4,500	1,760.00	7,920,000
スノーピーク	10,400	3,605.00	37,492,000
パラマウントベッドホールディングス	33,700	2,008.00	67,669,600
トランザクション	9,600	1,300.00	12,480,000
粧美堂	5,100	419.00	2,136,900
ニホンフラッシュ	15,000	1,258.00	18,870,000
前田工織	19,300	3,610.00	69,673,000
永大産業	22,900	299.00	6,847,100
アートネイチャー	16,900	692.00	11,694,800
バンダイナムコホールディングス	145,200	7,411.00	1,076,077,200
アイフィスジャパン	4,500	682.00	3,069,000
共立印刷	29,300	140.00	4,102,000
S H O E I	16,500	4,255.00	70,207,500
フランスベッドホールディングス	22,600	935.00	21,131,000
パイロットコーポレーション	29,600	3,835.00	113,516,000
萩原工業	9,700	1,451.00	14,074,700
トッパン・フォームズ	31,300	1,082.00	33,866,600
フジシールインターナショナル	36,100	2,250.00	81,225,000
タカラトミー	78,700	957.00	75,315,900
廣濟堂	12,200	861.00	10,504,200
エステールホールディングス	4,700	649.00	3,050,300
タカノ	6,000	657.00	3,942,000
プロネクサス	14,100	1,044.00	14,720,400
ホクシン	10,800	158.00	1,706,400
ウッドワン	5,900	1,213.00	7,156,700
大建工業	11,800	2,104.00	24,827,200
凸版印刷	266,800	1,810.00	482,908,000
大日本印刷	207,500	2,448.00	507,960,000
共同印刷	5,400	2,740.00	14,796,000
N I S S H A	36,000	1,609.00	57,924,000
光村印刷	1,500	1,642.00	2,463,000
T A K A R A & C O M P A N Y	8,600	1,819.00	15,643,400
アシックス	155,200	2,590.00	401,968,000
ツツミ	4,400	2,390.00	10,516,000

ローランド	13,700	5,440.00	74,528,000
小松ウオール工業	5,300	2,057.00	10,902,100
ヤマハ	104,400	6,050.00	631,620,000
河合楽器製作所	4,900	4,075.00	19,967,500
クリナップ	16,300	550.00	8,965,000
ピジョン	112,700	3,265.00	367,965,500
オリバー	3,700	3,780.00	13,986,000
兼松サステック	1,100	1,800.00	1,980,000
キングジム	14,300	892.00	12,755,600
リンテック	37,600	2,407.00	90,503,200
イトーキ	34,800	357.00	12,423,600
任天堂	100,500	63,720.00	6,403,860,000
三菱鉛筆	28,900	1,461.00	42,222,900
タカラスタANDARD	36,300	1,600.00	58,080,000
コクヨ	84,200	1,807.00	152,149,400
ナカバヤシ	17,300	600.00	10,380,000
グローブライド	8,500	4,900.00	41,650,000
オカムラ	60,300	1,516.00	91,414,800
美津濃	17,400	2,610.00	45,414,000
東京電力ホールディングス	1,488,800	329.00	489,815,200
中部電力	537,000	1,336.00	717,432,000
関西電力	665,000	1,047.00	696,255,000
中国電力	253,200	1,017.00	257,504,400
北陸電力	160,500	610.00	97,905,000
東北電力	411,100	861.00	353,957,100
四国電力	145,900	754.00	110,008,600
九州電力	387,600	842.00	326,359,200
北海道電力	164,300	514.00	84,450,200
沖縄電力	34,100	1,421.00	48,456,100
電源開発	139,700	1,624.00	226,872,800
エフオン	10,600	980.00	10,388,000
イーレックス	25,800	2,937.00	75,774,600
レノバ	29,800	4,885.00	145,573,000
東京瓦斯	337,600	2,058.50	694,949,600
大阪瓦斯	317,900	2,024.00	643,429,600
東邦瓦斯	86,300	5,560.00	479,828,000
北海道瓦斯	9,400	1,585.00	14,899,000
広島ガス	36,200	377.00	13,647,400
西部ガスホールディングス	19,800	2,515.00	49,797,000
静岡ガス	49,800	1,064.00	52,987,200
メタウォーター	19,700	2,048.00	40,345,600
SBSホールディングス	13,000	3,305.00	42,965,000

東武鉄道	182,900	2,925.00	534,982,500
相鉄ホールディングス	60,200	2,211.00	133,102,200
東急	442,700	1,582.00	700,351,400
京浜急行電鉄	225,400	1,391.00	313,531,400
小田急電鉄	281,100	2,842.00	798,886,200
京王電鉄	98,100	6,560.00	643,536,000
京成電鉄	131,500	3,645.00	479,317,500
富士急行	23,900	5,170.00	123,563,000
新京成電鉄	4,500	2,114.00	9,513,000
東日本旅客鉄道	308,900	8,099.00	2,501,781,100
西日本旅客鉄道	156,400	6,516.00	1,019,102,400
東海旅客鉄道	145,900	17,185.00	2,507,291,500
西武ホールディングス	211,500	1,350.00	285,525,000
鴻池運輸	27,900	1,222.00	34,093,800
西日本鉄道	48,700	2,757.00	134,265,900
ハマキョウレックス	13,500	3,220.00	43,470,000
サカイ引越センター	8,100	5,780.00	46,818,000
近鉄グループホールディングス	166,200	4,000.00	664,800,000
阪急阪神ホールディングス	221,700	3,505.00	777,058,500
南海電気鉄道	78,800	2,407.00	189,671,600
京阪ホールディングス	74,000	3,365.00	249,010,000
神戸電鉄	4,000	3,530.00	14,120,000
名古屋鉄道	136,700	2,050.00	280,235,000
山陽電気鉄道	11,900	1,938.00	23,062,200
アルプス物流	11,600	948.00	10,996,800
日本通運	57,500	8,240.00	473,800,000
ヤマトホールディングス	232,900	3,370.00	784,873,000
山九	42,600	5,000.00	213,000,000
丸運	9,500	273.00	2,593,500
丸全昭和運輸	13,500	3,285.00	44,347,500
センコーグループホールディングス	91,700	1,082.00	99,219,400
トナミホールディングス	4,000	5,180.00	20,720,000
ニッコンホールディングス	55,800	2,418.00	134,924,400
日本石油輸送	1,800	2,588.00	4,658,400
福山通運	21,300	4,130.00	87,969,000
セイノーホールディングス	124,500	1,402.00	174,549,000
エスライン	4,500	910.00	4,095,000
神奈川中央交通	4,100	3,560.00	14,596,000
日立物流	36,500	4,500.00	164,250,000
丸和運輸機関	35,100	1,533.00	53,808,300
C & F ロジホールディングス	16,800	1,605.00	26,964,000
九州旅客鉄道	128,600	2,593.00	333,459,800

S Gホールディングス	314,100	3,015.00	947,011,500
日本郵船	139,300	5,270.00	734,111,000
商船三井	99,000	4,980.00	493,020,000
川崎汽船	51,200	3,550.00	181,760,000
N Sユナイテッド海運	8,600	2,278.00	19,590,800
飯野海運	81,300	428.00	34,796,400
共栄タンカー	5,000	864.00	4,320,000
乾汽船	11,400	1,224.00	13,953,600
日本航空	405,000	2,471.00	1,000,755,000
A N Aホールディングス	448,700	2,724.00	1,222,258,800
パスコ	3,200	1,530.00	4,896,000
トランコム	5,100	8,500.00	43,350,000
日新	13,300	1,505.00	20,016,500
三菱倉庫	57,500	3,330.00	191,475,000
三井倉庫ホールディングス	17,600	2,595.00	45,672,000
住友倉庫	58,700	1,589.00	93,274,300
澁澤倉庫	9,100	2,137.00	19,446,700
東陽倉庫	27,900	316.00	8,816,400
日本トランスシティ	36,600	557.00	20,386,200
ケイヒン	3,200	1,367.00	4,374,400
中央倉庫	10,100	1,017.00	10,271,700
川西倉庫	3,000	1,158.00	3,474,000
安田倉庫	13,600	954.00	12,974,400
ファイズホールディングス	2,900	799.00	2,317,100
東洋埠頭	5,100	1,481.00	7,553,100
宇徳	11,800	532.00	6,277,600
上組	91,400	2,312.00	211,316,800
サンリツ	4,300	762.00	3,276,600
キムラユニティー	4,400	1,305.00	5,742,000
キューソー流通システム	4,100	1,690.00	6,929,000
近鉄エクスプレス	31,400	2,546.00	79,944,400
東海運	9,500	310.00	2,945,000
エーアイティー	10,400	1,098.00	11,419,200
内外トランスライン	5,800	1,937.00	11,234,600
日本コンセプト	5,300	1,832.00	9,709,600
N E C ネットエスアイ	57,200	1,796.00	102,731,200
クロスキャット	4,900	974.00	4,772,600
システナ	61,600	2,207.00	135,951,200
デジタルアーツ	10,100	8,370.00	84,537,000
日鉄ソリューションズ	25,000	3,505.00	87,625,000
キューブシステム	9,400	1,024.00	9,625,600
WOW WORLD	2,900	1,963.00	5,692,700

コア	7,600	1,446.00	10,989,600
ラクーンホールディングス	12,400	2,357.00	29,226,800
ソリトンシステムズ	8,900	1,584.00	14,097,600
ソフトクリエイティブホールディングス	6,900	2,744.00	18,933,600
T I S	172,400	2,913.00	502,201,200
J N Sホールディングス	8,500	600.00	5,100,000
グリー	106,300	607.00	64,524,100
G M Oペパボ	1,600	4,620.00	7,392,000
コーエーテクモホールディングス	45,900	5,130.00	235,467,000
三菱総合研究所	7,500	4,170.00	31,275,000
電算	2,100	2,321.00	4,874,100
A G S	9,200	883.00	8,123,600
ファインデックス	14,900	1,208.00	17,999,200
ブレインパッド	4,500	4,800.00	21,600,000
K L a b	31,600	638.00	20,160,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	23,300	1,071.00	24,954,300
イーブックイニシアティブジャパン	2,900	3,325.00	9,642,500
ネクソン	436,400	2,325.00	1,014,630,000
アイスタイル	53,300	494.00	26,330,200
エムアップホールディングス	4,600	3,470.00	15,962,000
エイチーム	12,100	1,522.00	18,416,200
エニグモ	16,600	1,440.00	23,904,000
テクノスジャパン	14,000	611.00	8,554,000
コロプラ	57,100	815.00	46,536,500
ブロードリーフ	86,100	521.00	44,858,100
クロス・マーケティンググループ	8,200	667.00	5,469,400
デジタルハーツホールディングス	8,100	1,551.00	12,563,100
システム情報	13,300	929.00	12,355,700
メディアドゥ	6,800	4,730.00	32,164,000
じげん	43,500	455.00	19,792,500
ブイキューブ	9,600	2,458.00	23,596,800
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	644.00	2,318,400
サイバーリンクス	5,900	1,532.00	9,038,800
フィックスターズ	18,800	840.00	15,792,000
C A R T A H O L D I N G S	7,200	1,957.00	14,090,400
オブティム	12,200	2,133.00	26,022,600
セレス	5,800	3,240.00	18,792,000
S H I F T	8,700	20,680.00	179,916,000
ティーガイア	18,500	2,007.00	37,129,500
セック	2,700	2,665.00	7,195,500
日本アジアグループ	16,600	960.00	15,936,000
テクマトリックス	26,900	1,889.00	50,814,100



プロシップ	5,300	1,423.00	7,541,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,700	2,077.00	86,610,900
GMOペイメントゲートウェイ	33,400	14,090.00	470,606,000
ザッパラス	7,500	516.00	3,870,000
システムリサーチ	5,200	2,248.00	11,689,600
インターネットイニシアティブ	46,000	3,675.00	169,050,000
さくらインターネット	19,100	617.00	11,784,700
ヴィンクス	5,200	949.00	4,934,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	4,695.00	18,310,500
SRAホールディングス	9,300	2,742.00	25,500,600
システムインテグレータ	5,400	654.00	3,531,600
朝日ネット	14,500	689.00	9,990,500
eBASE	21,000	844.00	17,724,000
アバント	18,700	1,672.00	31,266,400
アドソル日進	6,300	2,239.00	14,105,700
ODKソリューションズ	4,100	794.00	3,255,400
フリービット	10,700	784.00	8,388,800
コムチュア	16,000	2,441.00	39,056,000
サイバーコム	3,300	1,460.00	4,818,000
アステリア	12,900	834.00	10,758,600
アイル	9,800	1,390.00	13,622,000
マークライنز	7,300	2,951.00	21,542,300
メディカル・データ・ビジョン	19,800	2,071.00	41,005,800
gumi	24,300	769.00	18,686,700
ショーケース	4,300	712.00	3,061,600
モバイルファクトリー	4,200	1,141.00	4,792,200
テラスカイ	5,700	2,410.00	13,737,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,800	1,916.00	14,944,800
PCIホールディングス	8,000	1,164.00	9,312,000
パイプドHD	3,800	2,280.00	8,664,000
アイビーシー	3,200	950.00	3,040,000
ネオジャパン	3,500	1,471.00	5,148,500
PR TIMES	3,800	3,310.00	12,578,000
ラクス	52,000	3,415.00	177,580,000
ランドコンピュータ	3,000	1,108.00	3,324,000
ダブルスタンダード	2,300	5,560.00	12,788,000
オープンドア	10,400	2,336.00	24,294,400
マイネット	5,600	695.00	3,892,000
アカツキ	7,000	3,415.00	23,905,000
ベネフィットジャパン	1,500	1,982.00	2,973,000
Ubicomホールディングス	4,600	3,715.00	17,089,000
カナミックネットワーク	19,000	627.00	11,913,000

ノムラシステムコーポレーション	8,900	298.00	2,652,200	
チェンジ	31,800	2,754.00	87,577,200	
シンクロ・フード	11,300	369.00	4,169,700	
オークネット	9,400	1,414.00	13,291,600	
キャピタル・アセット・プランニング	3,800	999.00	3,796,200	
セグエグループ	4,800	1,082.00	5,193,600	
エイトレッド	3,400	2,286.00	7,772,400	
マクロミル	35,700	842.00	30,059,400	
ビーグリー	3,600	1,536.00	5,529,600	
オロ	5,500	3,860.00	21,230,000	
ユーザーローカル	5,400	2,004.00	10,821,600	
テモナ	4,100	1,109.00	4,546,900	
ニーズウェル	4,100	631.00	2,587,100	
サインポスト	4,100	789.00	3,234,900	
電算システムホールディングス	6,600	3,000.00	19,800,000	
ソルクシーズ	7,000	958.00	6,706,000	
フェイス	5,800	714.00	4,141,200	
プロトコーポレーション	20,900	1,368.00	28,591,200	
ハイマックス	5,200	1,109.00	5,766,800	
野村総合研究所	299,300	3,640.00	1,089,452,000	
サイバネットシステム	12,800	687.00	8,793,600	
C Eホールディングス	9,800	566.00	5,546,800	
日本システム技術	3,300	1,507.00	4,973,100	
インテージホールディングス	21,700	1,580.00	34,286,000	
東邦システムサイエンス	4,900	956.00	4,684,400	
ソースネクスト	83,000	314.00	26,062,000	
インフォコム	15,800	2,887.00	45,614,600	
HEROZ	5,100	2,158.00	11,005,800	
ラクスル	18,800	5,820.00	109,416,000	
I P S	4,200	2,985.00	12,537,000	
F I G	20,100	280.00	5,628,000	
システムサポート	5,400	1,345.00	7,263,000	
イーソル	9,700	1,056.00	10,243,200	
アルテリア・ネットワークス	19,300	1,927.00	37,191,100	
E d u L a b	1,700	5,370.00	9,129,000	
東海ソフト	2,900	1,515.00	4,393,500	
ウイングアーク1 s t	9,200	2,140.00	19,688,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	2,161.00	8,860,100	
サーバーワークス	1,800	4,010.00	7,218,000	
東名	2,000	1,063.00	2,126,000	
ヴィッツ	1,800	2,038.00	3,668,400	
トピラシステムズ	2,600	1,310.00	3,406,000	

Sansan	15,300	8,720.00	133,416,000
Link-U	3,400	1,644.00	5,589,600
ギフトィ	10,500	3,695.00	38,797,500
ベース	2,000	5,380.00	10,760,000
フォーカスシステムズ	11,900	986.00	11,733,400
クレスコ	11,500	1,910.00	21,965,000
フジ・メディア・ホールディングス	179,000	1,243.00	222,497,000
オービック	54,300	20,800.00	1,129,440,000
ジャストシステム	24,600	6,510.00	160,146,000
TDCソフト	15,500	1,032.00	15,996,000
Zホールディングス	2,367,000	559.70	1,324,809,900
トレンドマイクロ	92,100	5,820.00	536,022,000
IDホールディングス	10,300	927.00	9,548,100
日本オラクル	35,000	8,230.00	288,050,000
アルファシステムズ	4,700	3,750.00	17,625,000
フューチャー	21,000	1,954.00	41,034,000
CAC Holdings	11,500	1,460.00	16,790,000
S Bテクノロジー	6,300	3,030.00	19,089,000
トーセ	5,200	802.00	4,170,400
オービックビジネスコンサルタント	17,300	6,510.00	112,623,000
伊藤忠テクノソリューションズ	78,600	3,460.00	271,956,000
アイティフォー	23,000	786.00	18,078,000
東計電算	2,600	4,545.00	11,817,000
エクスネット	3,100	1,031.00	3,196,100
大塚商会	93,300	5,830.00	543,939,000
サイボウズ	20,300	2,537.00	51,501,100
電通国際情報サービス	21,400	4,735.00	101,329,000
ACCESS	22,000	887.00	19,514,000
デジタルガレージ	28,500	4,990.00	142,215,000
EMシステムズ	28,900	839.00	24,247,100
ウェザーニューズ	5,200	5,610.00	29,172,000
CIJ	12,100	846.00	10,236,600
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,185.00	5,733,000
日本エンタープライズ	19,400	213.00	4,132,200
WOWOW	8,400	2,468.00	20,731,200
スカラ	15,900	775.00	12,322,500
インテリジェント ウェイブ	10,700	597.00	6,387,900
IMAGICA GROUP	15,500	439.00	6,804,500
ネットワンシステムズ	70,400	3,815.00	268,576,000
システムソフト	37,900	256.00	9,702,400
アルゴグラフィックス	13,500	3,545.00	47,857,500
マーベラス	27,600	767.00	21,169,200

エイベックス	29,900	1,746.00	52,205,400
日本ユニシス	59,900	3,480.00	208,452,000
兼松エレクトロニクス	9,500	3,695.00	35,102,500
都築電気	7,900	1,619.00	12,790,100
TBSホールディングス	114,500	1,735.00	198,657,500
日本テレビホールディングス	144,100	1,277.00	184,015,700
朝日放送グループホールディングス	17,700	706.00	12,496,200
テレビ朝日ホールディングス	53,500	1,743.00	93,250,500
スカパーJSAホールディングス	114,400	412.00	47,132,800
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,148.00	26,850,000
日本BS放送	6,200	1,099.00	6,813,800
ビジョン	21,700	1,083.00	23,501,100
スマートバリュー	5,100	677.00	3,452,700
ワイヤレスゲート	8,000	434.00	3,472,000
コネクシオ	10,000	1,564.00	15,640,000
クロップス	3,600	887.00	3,193,200
日本電信電話	2,014,700	2,882.00	5,806,365,400
KDDI	1,381,400	3,492.00	4,823,848,800
ソフトバンク	1,565,500	1,470.00	2,301,285,000
光通信	20,300	20,610.00	418,383,000
エムティーアイ	17,300	689.00	11,919,700
GMOインターネット	61,100	2,997.00	183,116,700
ファイバーゲート	5,800	1,481.00	8,589,800
アйдママーケティングコミュニケーション	5,400	402.00	2,170,800
KADOKAWA	44,700	4,300.00	192,210,000
学研ホールディングス	24,600	1,334.00	32,816,400
ゼンリン	31,600	1,151.00	36,371,600
昭文社ホールディングス	7,800	490.00	3,822,000
インプレスホールディングス	14,300	246.00	3,517,800
アイネット	9,100	1,460.00	13,286,000
松竹	11,400	12,690.00	144,666,000
東宝	101,700	4,640.00	471,888,000
東映	5,700	20,290.00	115,653,000
エヌ・ティ・ティ・データ	458,800	1,754.00	804,735,200
ピー・シー・エー	2,600	3,885.00	10,101,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	1,762.00	10,748,200
DTS	35,900	2,722.00	97,719,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,500	5,280.00	388,080,000
シーイーシー	18,700	1,637.00	30,611,900
カブコン	147,800	3,095.00	457,441,000
アイ・エス・ビー	8,200	1,532.00	12,562,400
ジャステック	11,300	1,243.00	14,045,900

S C S K	39,800	6,830.00	271,834,000	
日本システムウエア	5,900	2,324.00	13,711,600	
アイネス	17,200	1,408.00	24,217,600	
T K C	29,300	3,360.00	98,448,000	
富士ソフト	18,400	5,680.00	104,512,000	
N S D	55,600	1,853.00	103,026,800	
コナミホールディングス	62,600	6,300.00	394,380,000	
福井コンピュータホールディングス	8,000	4,305.00	34,440,000	
J B C Cホールディングス	11,900	1,476.00	17,564,400	
ミロク情報サービス	17,300	1,725.00	29,842,500	
ソフトバンクグループ	1,366,800	7,540.00	10,305,672,000	
ハウスイ	1,400	940.00	1,316,000	
高千穂交易	6,700	1,148.00	7,691,600	
オルバヘルスケアホールディングス	2,800	1,691.00	4,734,800	
伊藤忠食品	4,200	5,320.00	22,344,000	
エレマテック	13,900	1,253.00	17,416,700	
J A L U X	4,900	1,801.00	8,824,900	
あらた	13,800	4,310.00	59,478,000	
トーメンデバイス	2,200	4,105.00	9,031,000	
東京エレクトロン デバイス	5,700	5,410.00	30,837,000	
フィールズ	15,100	536.00	8,093,600	
双日	954,800	338.00	322,722,400	
アルフレッサ ホールディングス	179,300	1,716.00	307,678,800	
横浜冷凍	48,500	900.00	43,650,000	
ラサ商事	9,200	902.00	8,298,400	
アルコニックス	18,400	1,475.00	27,140,000	
神戸物産	119,300	3,845.00	458,708,500	
ハイパー	3,600	544.00	1,958,400	
あい ホールディングス	24,700	2,167.00	53,524,900	
ディーブイエックス	5,300	1,000.00	5,300,000	
ダイワボウホールディングス	78,800	2,015.00	158,782,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	41,200	2,617.00	107,820,400	
ラクト・ジャパン	7,600	2,755.00	20,938,000	
グリムス	5,100	1,971.00	10,052,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,100	754.00	22,695,400	
八洲電機	13,400	970.00	12,998,000	
メディアスホールディングス	9,800	1,046.00	10,250,800	
レスターホールディングス	18,000	1,950.00	35,100,000	
ジュテックホールディングス	4,000	1,038.00	4,152,000	
大光	6,700	685.00	4,589,500	
O C H Iホールディングス	5,000	1,282.00	6,410,000	
T O K A Iホールディングス	83,800	913.00	76,509,400	

黒谷	4,700	905.00	4,253,500
C o m i n i x	3,100	730.00	2,263,000
三洋貿易	17,400	1,264.00	21,993,600
ビューティガレージ	2,800	4,470.00	12,516,000
ウイン・パートナーズ	12,500	1,015.00	12,687,500
ミタチ産業	4,800	808.00	3,878,400
シップヘルスケアホールディングス	61,000	2,709.00	165,249,000
明治電機工業	6,000	1,407.00	8,442,000
デリカフーズホールディングス	6,800	652.00	4,433,600
スターティアホールディングス	3,400	2,017.00	6,857,800
コメダホールディングス	37,700	2,084.00	78,566,800
ピーバンドットコム	2,400	787.00	1,888,800
アセンテック	4,500	1,205.00	5,422,500
富士興産	5,300	1,089.00	5,771,700
協栄産業	1,900	1,435.00	2,726,500
小野建	15,500	1,305.00	20,227,500
南陽	3,500	2,006.00	7,021,000
佐島電機	10,800	818.00	8,834,400
エコトレーディング	3,700	661.00	2,445,700
伯東	10,600	1,523.00	16,143,800
コンドーテック	13,400	1,011.00	13,547,400
中山福	10,000	435.00	4,350,000
ナガイレーベン	22,900	2,572.00	58,898,800
三菱食品	19,000	2,826.00	53,694,000
松田産業	12,600	2,201.00	27,732,600
第一興商	34,000	4,350.00	147,900,000
メディバルホールディングス	173,300	2,163.00	374,847,900
S P K	7,400	1,377.00	10,189,800
萩原電気ホールディングス	6,400	2,267.00	14,508,800
アズワン	12,400	15,050.00	186,620,000
スズデン	6,000	1,472.00	8,832,000
尾家産業	5,100	1,235.00	6,298,500
シモジマ	10,600	1,079.00	11,437,400
ドウシシャ	16,300	1,722.00	28,068,600
小津産業	3,800	1,950.00	7,410,000
高速	9,200	1,468.00	13,505,600
たけびし	6,100	1,559.00	9,509,900
リックス	3,900	1,517.00	5,916,300
丸文	15,400	642.00	9,886,800
ハピネット	14,400	1,493.00	21,499,200
橋本総業ホールディングス	3,500	2,766.00	9,681,000
日本ライフライン	55,900	1,400.00	78,260,000

タカショー	11,300	870.00	9,831,000
マルカ	5,600	2,510.00	14,056,000
I D O M	58,300	691.00	40,285,300
進和	10,200	2,247.00	22,919,400
エスケイジャパン	4,300	482.00	2,072,600
ダイترون	7,300	1,980.00	14,454,000
シークス	22,000	1,438.00	31,636,000
田中商事	5,400	669.00	3,612,600
オーハシテクニカ	8,900	1,543.00	13,732,700
白銅	6,200	2,188.00	13,565,600
ダイコー通産	2,100	1,298.00	2,725,800
伊藤忠商事	1,209,200	3,245.00	3,923,854,000
丸紅	1,704,800	966.20	1,647,177,760
高島	2,800	1,844.00	5,163,200
長瀬産業	94,900	1,681.00	159,526,900
蝶理	11,100	1,774.00	19,691,400
豊田通商	173,700	5,240.00	910,188,000
三共生興	26,200	570.00	14,934,000
兼松	69,100	1,464.00	101,162,400
ツカモトコーポレーション	2,900	1,426.00	4,135,400
三井物産	1,379,100	2,562.50	3,533,943,750
日本紙パルプ商事	9,000	3,680.00	33,120,000
カメイ	22,600	1,185.00	26,781,000
東都水産	2,000	5,070.00	10,140,000
O U Gホールディングス	2,700	2,872.00	7,754,400
スターゼン	12,800	2,168.00	27,750,400
山善	67,600	1,018.00	68,816,800
椿本興業	3,200	3,420.00	10,944,000
住友商事	1,091,000	1,495.50	1,631,590,500
内田洋行	7,400	4,950.00	36,630,000
三菱商事	1,052,500	3,104.00	3,266,960,000
第一実業	7,900	4,410.00	34,839,000
キャノンマーケティングジャパン	42,900	2,596.00	111,368,400
西華産業	9,100	1,653.00	15,042,300
佐藤商事	14,300	1,129.00	16,144,700
菱洋エレクトロ	13,200	2,604.00	34,372,800
東京産業	15,700	630.00	9,891,000
ユアサ商事	17,700	3,080.00	54,516,000
神鋼商事	3,900	2,391.00	9,324,900
トルク	10,500	235.00	2,467,500
阪和興業	34,600	3,120.00	107,952,000
正栄食品工業	11,200	3,915.00	43,848,000

カナデン	14,100	1,066.00	15,030,600
菱電商事	12,500	1,653.00	20,662,500
フルサト工業	8,800	1,966.00	17,300,800
岩谷産業	41,500	6,380.00	264,770,000
ナイス	6,800	1,992.00	13,545,600
ニチモウ	2,700	2,080.00	5,616,000
極東貿易	5,000	2,635.00	13,175,000
アステナホールディングス	25,300	608.00	15,382,400
三愛石油	42,600	1,392.00	59,299,200
稲畑産業	41,600	1,683.00	70,012,800
G S I クレオス	8,500	963.00	8,185,500
明和産業	16,000	473.00	7,568,000
クワザワホールディングス	6,200	619.00	3,837,800
ヤマエ久野	12,600	1,196.00	15,069,600
ワキタ	34,100	1,022.00	34,850,200
東邦ホールディングス	55,500	1,892.00	105,006,000
サンゲツ	46,500	1,611.00	74,911,500
ミツウロコグループホールディングス	25,500	1,316.00	33,558,000
シナネンホールディングス	6,400	3,150.00	20,160,000
伊藤忠エネクス	38,300	993.00	38,031,900
サンリオ	48,600	2,012.00	97,783,200
サンワテクノス	11,400	1,290.00	14,706,000
リョーサン	19,100	2,158.00	41,217,800
新光商事	23,400	781.00	18,275,400
トーヨー	7,800	1,585.00	12,363,000
三信電気	9,300	2,154.00	20,032,200
東陽テクニカ	17,100	1,115.00	19,066,500
モスフードサービス	24,400	3,170.00	77,348,000
加賀電子	15,700	2,944.00	46,220,800
ソーダニッカ	16,500	555.00	9,157,500
立花エレテック	12,800	1,470.00	18,816,000
フォーバル	6,100	959.00	5,849,900
P A L T A C	27,700	5,350.00	148,195,000
三谷産業	22,800	385.00	8,778,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,900	2,749.00	10,721,100
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,999.00	3,198,400
コア商事ホールディングス	13,000	665.00	8,645,000
国際紙パルプ商事	37,000	259.00	9,583,000
ヤマタネ	7,400	1,538.00	11,381,200
丸紅建材リース	1,700	1,895.00	3,221,500
日鉄物産	12,300	4,470.00	54,981,000
泉州電業	4,900	3,850.00	18,865,000



トラスコ中山	39,600	2,824.00	111,830,400
オートバックスセブン	63,500	1,545.00	98,107,500
モリト	12,700	615.00	7,810,500
加藤産業	25,000	3,380.00	84,500,000
北恵	4,400	972.00	4,276,800
イノテック	9,700	1,367.00	13,259,900
イエローハット	32,700	2,054.00	67,165,800
J Kホールディングス	15,700	815.00	12,795,500
日伝	14,400	2,192.00	31,564,800
北沢産業	11,900	251.00	2,986,900
杉本商事	8,700	2,291.00	19,931,700
因幡電機産業	46,100	2,637.00	121,565,700
東テク	5,700	2,818.00	16,062,600
ミスミグループ本社	216,900	3,985.00	864,346,500
アルテック	12,800	318.00	4,070,400
タキヒヨー	5,700	1,893.00	10,790,100
蔵王産業	3,400	1,508.00	5,127,200
スズケン	73,200	3,350.00	245,220,000
ジェコス	12,000	897.00	10,764,000
グローセル	18,800	440.00	8,272,000
ローソン	43,800	5,320.00	233,016,000
サンエー	13,200	4,155.00	54,846,000
カワチ薬品	12,200	2,196.00	26,791,200
エービーシー・マート	27,100	6,410.00	173,711,000
ハードオフコーポレーション	8,100	777.00	6,293,700
アスクル	28,200	1,634.00	46,078,800
ゲオホールディングス	23,400	1,228.00	28,735,200
アダストリア	24,100	1,979.00	47,693,900
くら寿司	20,400	4,175.00	85,170,000
キャンドゥ	8,400	1,913.00	16,069,200
アイケイ	5,500	775.00	4,262,500
パルグループホールディングス	15,400	1,704.00	26,241,600
エディオン	73,600	1,093.00	80,444,800
サーラコーポレーション	35,800	613.00	21,945,400
ワッツ	8,800	914.00	8,043,200
ハローズ	7,100	2,785.00	19,773,500
フジオフードグループ本社	14,600	1,305.00	19,053,000
あみやき亭	3,900	2,945.00	11,485,500
大黒天物産	5,600	6,320.00	35,392,000
ハニーズホールディングス	14,100	1,213.00	17,103,300
ファーマライズホールディングス	4,700	736.00	3,459,200
アルペン	13,400	3,050.00	40,870,000

ハブ	6,100	700.00	4,270,000
クオールホールディングス	23,600	1,512.00	35,683,200
ジーンズホールディングス	11,800	8,170.00	96,406,000
ビックカメラ	102,900	1,135.00	116,791,500
D C Mホールディングス	107,100	1,084.00	116,096,400
Monotaro	246,000	2,639.00	649,194,000
東京一番フーズ	5,100	593.00	3,024,300
きちりホールディングス	4,600	596.00	2,741,600
アークランドサービスホールディングス	14,600	2,223.00	32,455,800
J.フロント リテイリング	206,800	1,025.00	211,970,000
ドトール・日レスホールディングス	27,600	1,759.00	48,548,400
マツモトキヨシホールディングス	71,500	4,850.00	346,775,000
ブロンコピリー	9,200	2,402.00	22,098,400
Z O Z O	102,000	3,535.00	360,570,000
トレジャー・ファクトリー	5,500	994.00	5,467,000
物語コーポレーション	9,300	7,390.00	68,727,000
ココカラファイン	15,500	8,180.00	126,790,000
三越伊勢丹ホールディングス	303,000	823.00	249,369,000
Hamee	4,700	1,479.00	6,951,300
マーケットエンタープライズ	1,500	1,135.00	1,702,500
ウエルシアホールディングス	91,500	3,375.00	308,812,500
クリエイトSDホールディングス	25,600	3,200.00	81,920,000
丸善CHIホールディングス	20,200	402.00	8,120,400
ミサワ	4,100	699.00	2,865,900
ティーライフ	2,600	1,556.00	4,045,600
チムニー	5,300	1,420.00	7,526,000
シュッピン	12,100	1,070.00	12,947,000
オイシックス・ラ・大地	22,900	4,250.00	97,325,000
ネクステージ	30,700	2,170.00	66,619,000
ジョイフル本田	50,900	1,376.00	70,038,400
鳥貴族ホールディングス	6,600	1,866.00	12,315,600
ホットランド	13,200	1,331.00	17,569,200
すかいらーくホールディングス	220,600	1,514.00	333,988,400
SFPホールディングス	8,400	1,501.00	12,608,400
綿半ホールディングス	13,300	1,238.00	16,465,400
ヨシックスホールディングス	3,600	2,350.00	8,460,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,600	1,019.00	51,561,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,200	1,762.00	16,210,400
B E E N O S	8,800	3,530.00	31,064,000
あさひ	13,200	1,359.00	17,938,800
日本調剤	10,700	1,670.00	17,869,000
コスモス薬品	17,500	16,220.00	283,850,000

トーエル	8,900	827.00	7,360,300
オンリー	3,800	474.00	1,801,200
セブン&アイ・ホールディングス	676,300	5,088.00	3,441,014,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	92,900	983.00	91,320,700
ツルハホールディングス	37,700	12,550.00	473,135,000
サンマルクホールディングス	13,900	1,603.00	22,281,700
フェリシモ	4,100	1,693.00	6,941,300
トリドールホールディングス	43,000	1,904.00	81,872,000
TOKYO BASE	16,200	686.00	11,113,200
ウイルプラスホールディングス	3,100	1,038.00	3,217,800
JMホールディングス	11,800	2,134.00	25,181,200
サツドラホールディングス	2,800	2,011.00	5,630,800
アレンザホールディングス	13,500	1,258.00	16,983,000
串カツ田中ホールディングス	4,800	1,863.00	8,942,400
バロックジャパンリミテッド	12,500	819.00	10,237,500
クスリのアオキホールディングス	17,200	7,300.00	125,560,000
力の源ホールディングス	7,900	619.00	4,890,100
FOOD & LIFE COMPANIES	101,300	4,240.00	429,512,000
メディカルシステムネットワーク	15,600	746.00	11,637,600
はるやまホールディングス	8,700	641.00	5,576,700
ノジマ	30,900	2,782.00	85,963,800
カッパ・クリエイト	24,200	1,460.00	35,332,000
ライトオン	12,900	723.00	9,326,700
良品計画	199,100	2,093.00	416,716,300
三城ホールディングス	22,900	269.00	6,160,100
アドヴァングループ	18,000	924.00	16,632,000
アルビス	5,700	2,324.00	13,246,800
コナカ	20,400	350.00	7,140,000
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,653.00	3,967,200
G - 7ホールディングス	8,500	3,455.00	29,367,500
イオン北海道	23,000	1,053.00	24,219,000
コジマ	30,300	684.00	20,725,200
ヒマラヤ	6,400	1,059.00	6,777,600
コーナン商事	24,700	3,785.00	93,489,500
エコス	6,600	1,913.00	12,625,800
ワタミ	22,700	965.00	21,905,500
マルシェ	4,500	501.00	2,254,500
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	345,700	2,409.00	832,791,300
西松屋チェーン	38,200	1,399.00	53,441,800
ゼンショーホールディングス	93,000	2,820.00	262,260,000

幸楽苑ホールディングス	11,000	1,529.00	16,819,000
ハークスレイ	4,000	976.00	3,904,000
サイゼリヤ	25,800	2,680.00	69,144,000
V Tホールディングス	66,000	459.00	30,294,000
魚力	5,600	2,092.00	11,715,200
フジ・コーポレーション	9,500	1,266.00	12,027,000
ユナイテッドアローズ	20,000	2,121.00	42,420,000
ハイデイ日高	25,200	1,875.00	47,250,000
京都きもの友禅	12,600	261.00	3,288,600
コロワイド	57,400	2,028.00	116,407,200
ピーシーデポコーポレーション	21,000	491.00	10,311,000
壱番屋	12,300	4,965.00	61,069,500
P L A N T	5,000	719.00	3,595,000
スギホールディングス	34,600	7,790.00	269,534,000
薬王堂ホールディングス	7,700	2,311.00	17,794,700
スクロール	25,200	856.00	21,571,200
ヨンドシーホールディングス	16,100	1,832.00	29,495,200
木曽路	22,800	2,415.00	55,062,000
S R Sホールディングス	23,000	815.00	18,745,000
リテールパートナーズ	21,300	1,200.00	25,560,000
ケーヨー	32,200	851.00	27,402,200
上新電機	20,000	2,662.00	53,240,000
日本瓦斯	84,800	1,838.00	155,862,400
ロイヤルホールディングス	30,200	2,065.00	62,363,000
いなげや	19,400	1,467.00	28,459,800
チヨダ	18,200	883.00	16,070,600
ライフコーポレーション	17,100	3,390.00	57,969,000
リンガーハット	21,300	2,339.00	49,820,700
M r M a x H D	24,400	646.00	15,762,400
A O K Iホールディングス	34,900	673.00	23,487,700
オークワ	27,300	1,095.00	29,893,500
コメリ	26,800	2,616.00	70,108,800
青山商事	39,000	749.00	29,211,000
しまむら	20,200	10,120.00	204,424,000
はせがわ	10,700	276.00	2,953,200
高島屋	126,100	1,264.00	159,390,400
松屋	37,900	1,028.00	38,961,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	82,100	949.00	77,912,900
近鉄百貨店	6,700	3,165.00	21,205,500
丸井グループ	146,300	2,090.00	305,767,000
アクシアル リテイリング	14,500	3,825.00	55,462,500
イオン	665,300	2,929.00	1,948,663,700

イズミ	35,200	4,095.00	144,144,000
平和堂	32,000	2,052.00	65,664,000
フジ	21,000	1,946.00	40,866,000
ヤオコー	19,700	6,230.00	122,731,000
ゼビオホールディングス	21,300	1,005.00	21,406,500
ケーズホールディングス	147,500	1,243.00	183,342,500
Olympicグループ	9,500	760.00	7,220,000
日産東京販売ホールディングス	27,100	242.00	6,558,200
シルバーライフ	3,700	2,059.00	7,618,300
Genky DrugStores	7,700	4,095.00	31,531,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,700	1,119.00	4,140,300
ブックオフグループホールディングス	10,100	972.00	9,817,200
ギフト	2,300	2,416.00	5,556,800
アインホールディングス	25,200	6,650.00	167,580,000
元気寿司	5,000	2,546.00	12,730,000
ヤマダホールディングス	580,200	502.00	291,260,400
アークランドサカモト	27,300	1,474.00	40,240,200
ニトリホールディングス	68,600	19,695.00	1,351,077,000
グルメ杵屋	12,800	969.00	12,403,200
愛眼	13,800	226.00	3,118,800
ケーユーホールディングス	9,500	960.00	9,120,000
吉野家ホールディングス	57,000	2,142.00	122,094,000
松屋フーズホールディングス	8,400	3,610.00	30,324,000
サガミホールディングス	24,900	1,024.00	25,497,600
関西スーパーマーケット	13,500	992.00	13,392,000
王将フードサービス	11,500	5,840.00	67,160,000
プレナス	19,600	2,075.00	40,670,000
ミニストップ	12,900	1,393.00	17,969,700
アークス	33,200	2,218.00	73,637,600
パローホールディングス	35,500	2,206.00	78,313,000
ベルク	8,600	5,180.00	44,548,000
大庄	9,600	1,067.00	10,243,200
ファーストリテイリング	23,100	80,610.00	1,862,091,000
サンドラッグ	65,200	3,485.00	227,222,000
サックスパーホールディングス	15,300	617.00	9,440,100
ヤマザワ	4,300	1,705.00	7,331,500
やまや	3,500	2,315.00	8,102,500
ベルーナ	37,500	932.00	34,950,000
島根銀行	6,000	617.00	3,702,000
じもとホールディングス	11,700	642.00	7,511,400
めぶきフィナンシャルグループ	899,500	237.00	213,181,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	1,524.00	33,070,800

九州フィナンシャルグループ	353,500	394.00	139,279,000
ゆうちょ銀行	490,500	928.00	455,184,000
富山第一銀行	41,300	278.00	11,481,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,054,700	401.00	422,934,700
西日本フィナンシャルホールディングス	113,100	628.00	71,026,800
三十三フィナンシャルグループ	15,000	1,382.00	20,730,000
第四北越フィナンシャルグループ	28,200	2,429.00	68,497,800
ひろぎんホールディングス	255,300	588.00	150,116,400
新生銀行	141,200	1,466.00	206,999,200
あおぞら銀行	103,100	2,485.00	256,203,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,842,500	593.10	7,023,786,750
りそなホールディングス	1,997,900	420.80	840,716,320
三井住友トラスト・ホールディングス	327,200	3,558.00	1,164,177,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,198,100	3,769.00	4,515,638,900
千葉銀行	577,700	652.00	376,660,400
群馬銀行	356,300	349.00	124,348,700
武蔵野銀行	25,800	1,695.00	43,731,000
千葉興業銀行	44,100	257.00	11,333,700
筑波銀行	72,000	172.00	12,384,000
七十七銀行	54,300	1,171.00	63,585,300
青森銀行	13,400	2,113.00	28,314,200
秋田銀行	10,400	1,411.00	14,674,400
山形銀行	19,500	860.00	16,770,000
岩手銀行	11,300	1,716.00	19,390,800
東邦銀行	154,800	212.00	32,817,600
東北銀行	8,300	1,010.00	8,383,000
みちのく銀行	11,100	914.00	10,145,400
ふくおかフィナンシャルグループ	156,200	1,876.00	293,031,200
静岡銀行	421,600	831.00	350,349,600
十六銀行	21,700	1,953.00	42,380,100
スルガ銀行	151,800	326.00	49,486,800
八十二銀行	389,900	359.00	139,974,100
山梨中央銀行	20,100	825.00	16,582,500
大垣共立銀行	34,200	1,870.00	63,954,000
福井銀行	14,800	1,396.00	20,660,800
北國銀行	16,100	2,132.00	34,325,200
清水銀行	7,100	1,542.00	10,948,200
富山銀行	3,300	2,257.00	7,448,100
滋賀銀行	34,700	1,934.00	67,109,800
南都銀行	25,200	1,874.00	47,224,800
百五銀行	155,800	310.00	48,298,000
京都銀行	62,000	4,955.00	307,210,000

紀陽銀行	61,300	1,502.00	92,072,600
ほくほくフィナンシャルグループ	115,200	806.00	92,851,200
山陰合同銀行	109,100	547.00	59,677,700
中国銀行	149,000	870.00	129,630,000
鳥取銀行	5,500	1,118.00	6,149,000
伊予銀行	229,400	546.00	125,252,400
百十四銀行	18,400	1,511.00	27,802,400
四国銀行	24,500	702.00	17,199,000
阿波銀行	26,500	2,051.00	54,351,500
大分銀行	10,000	1,703.00	17,030,000
宮崎銀行	10,800	2,004.00	21,643,200
佐賀銀行	9,800	1,372.00	13,445,600
沖縄銀行	15,900	2,548.00	40,513,200
琉球銀行	37,600	716.00	26,921,600
セブン銀行	578,400	234.00	135,345,600
みずほフィナンシャルグループ	2,352,400	1,586.50	3,732,082,600
高知銀行	6,300	807.00	5,084,100
山口フィナンシャルグループ	216,100	633.00	136,791,300
長野銀行	5,700	1,087.00	6,195,900
名古屋銀行	13,900	2,522.00	35,055,800
北洋銀行	261,000	239.00	62,379,000
愛知銀行	5,800	2,831.00	16,419,800
中京銀行	6,200	1,430.00	8,866,000
大光銀行	5,900	1,319.00	7,782,100
愛媛銀行	24,200	766.00	18,537,200
トマト銀行	6,700	1,032.00	6,914,400
京葉銀行	73,800	411.00	30,331,800
栃木銀行	83,600	172.00	14,379,200
北日本銀行	5,400	1,628.00	8,791,200
東和銀行	30,400	497.00	15,108,800
福島銀行	19,800	237.00	4,692,600
大東銀行	8,300	613.00	5,087,900
トモニホールディングス	133,800	297.00	39,738,600
フィデアホールディングス	168,100	122.00	20,508,200
池田泉州ホールディングス	199,100	160.00	31,856,000
F P G	58,600	746.00	43,715,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,800	1,506.00	17,770,800
マーキュリアホールディングス	7,100	737.00	5,232,700
S B I ホールディングス	213,400	2,630.00	561,242,000
ジャフコ グループ	24,800	6,460.00	160,208,000
大和証券グループ本社	1,297,000	575.80	746,812,600
野村ホールディングス	2,643,700	552.20	1,459,851,140

岡三証券グループ	148,100	422.00	62,498,200
丸三証券	51,900	621.00	32,229,900
東洋証券	58,700	158.00	9,274,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,300	393.00	72,822,900
光世証券	4,600	588.00	2,704,800
水戸証券	47,100	300.00	14,130,000
いちよし証券	35,100	592.00	20,779,200
松井証券	85,100	819.00	69,696,900
マネックスグループ	155,600	719.00	111,876,400
極東証券	23,500	835.00	19,622,500
岩井コスモホールディングス	17,900	1,673.00	29,946,700
藍澤証券	31,300	1,060.00	33,178,000
マネーパートナーズグループ	19,600	226.00	4,429,600
スパークス・グループ	81,000	254.00	20,574,000
かんぽ生命保険	214,600	1,980.00	424,908,000
S O M P Oホールディングス	305,200	4,341.00	1,324,873,200
アニコム ホールディングス	48,700	899.00	43,781,300
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	420,400	3,309.00	1,391,103,600
第一生命ホールディングス	852,000	1,962.00	1,671,624,000
東京海上ホールディングス	570,200	5,139.00	2,930,257,800
T & Dホールディングス	517,400	1,407.00	727,981,800
アドバンスクリエイト	8,300	980.00	8,134,000
全国保証	45,100	4,930.00	222,343,000
あんしん保証	6,700	336.00	2,251,200
イントラスト	5,300	677.00	3,588,100
日本モーゲージサービス	9,100	1,012.00	9,209,200
C a s a	5,100	989.00	5,043,900
アルヒ	25,700	1,425.00	36,622,500
プレミアグループ	8,100	3,465.00	28,066,500
クレディセゾン	101,300	1,347.00	136,451,100
芙蓉総合リース	18,200	7,080.00	128,856,000
みずほリース	26,800	3,605.00	96,614,000
東京センチュリー	40,300	6,000.00	241,800,000
日本証券金融	73,600	824.00	60,646,400
アイフル	291,200	371.00	108,035,200
リコーリース	13,700	3,460.00	47,402,000
イオンフィナンシャルサービス	106,100	1,382.00	146,630,200
アコム	348,500	470.00	163,795,000
ジャックス	19,200	2,575.00	49,440,000
オリエントコーポレーション	470,100	148.00	69,574,800
オリックス	1,051,100	1,890.50	1,987,104,550
三菱HCキャピタル	599,200	600.00	359,520,000



九州リースサービス	8,900	649.00	5,776,100
日本取引所グループ	467,800	2,509.50	1,173,944,100
イー・ギャランティ	20,400	2,376.00	48,470,400
アサックス	9,400	684.00	6,429,600
N E C キャピタルソリューション	7,200	2,162.00	15,566,400
いちご	197,200	364.00	71,780,800
日本駐車場開発	199,500	168.00	33,516,000
スター・マイカ・ホールディングス	10,300	1,197.00	12,329,100
S R E ホールディングス	2,800	7,390.00	20,692,000
A D ワークスグループ	35,100	157.00	5,510,700
ヒューリック	368,500	1,275.00	469,837,500
三栄建築設計	7,700	2,044.00	15,738,800
野村不動産ホールディングス	99,900	2,779.00	277,622,100
三重交通グループホールディングス	38,500	472.00	18,172,000
サムティ	25,300	2,297.00	58,114,100
ディア・ライフ	25,700	476.00	12,233,200
日本商業開発	11,900	1,719.00	20,456,100
プレサンスコーポレーション	29,600	1,551.00	45,909,600
ハウスコム	4,300	1,235.00	5,310,500
日本管理センター	10,600	1,300.00	13,780,000
サンセイランディック	6,900	874.00	6,030,600
フージャースホールディングス	28,200	747.00	21,065,400
オープンハウス	55,300	5,320.00	294,196,000
東急不動産ホールディングス	473,200	655.00	309,946,000
飯田グループホールディングス	145,000	2,670.00	387,150,000
イーランド	4,400	1,033.00	4,545,200
ムゲンエステート	13,800	509.00	7,024,200
ハウズドゥ	8,500	1,007.00	8,559,500
シーアールイー	5,500	1,587.00	8,728,500
グッドコムアセット	9,400	1,458.00	13,705,200
ジェイ・エス・ビー	3,600	3,905.00	14,058,000
テンポイノベーション	6,700	895.00	5,996,500
フェイスネットワーク	2,600	1,365.00	3,549,000
パーク24	93,700	2,067.00	193,677,900
パラカ	5,400	1,700.00	9,180,000
三井不動産	789,700	2,686.00	2,121,134,200
三菱地所	1,138,200	1,781.50	2,027,703,300
平和不動産	30,100	3,805.00	114,530,500
東京建物	172,000	1,648.00	283,456,000
ダイビル	45,000	1,439.00	64,755,000
京阪神ビルディング	31,000	1,432.00	44,392,000
住友不動産	389,600	3,842.00	1,496,843,200

テーオーシー	36,400	677.00	24,642,800
東京楽天地	3,200	4,150.00	13,280,000
スターツコーポレーション	21,200	2,898.00	61,437,600
フジ住宅	22,600	634.00	14,328,400
空港施設	20,100	588.00	11,818,800
明和地所	10,800	630.00	6,804,000
ゴールドクレスト	16,600	1,680.00	27,888,000
エスリード	7,800	1,600.00	12,480,000
日神グループホールディングス	29,100	466.00	13,560,600
日本エスコン	31,400	773.00	24,272,200
タカラレーベン	72,500	346.00	25,085,000
A V A N T I A	10,700	910.00	9,737,000
イオンモール	87,700	1,678.00	147,160,600
毎日コムネット	8,100	731.00	5,921,100
ファースト住建	8,700	1,169.00	10,170,300
カチタス	43,400	3,260.00	141,484,000
トーセイ	25,300	1,199.00	30,334,700
穴吹興産	4,600	1,982.00	9,117,200
サンフロンティア不動産	22,700	1,098.00	24,924,600
エフ・ジェー・ネクスト	18,600	1,037.00	19,288,200
インテリックス	3,900	710.00	2,769,000
ランドビジネス	7,300	330.00	2,409,000
サンネクスタグループ	7,100	985.00	6,993,500
グランディハウス	15,500	431.00	6,680,500
日本空港ビルデング	60,500	5,230.00	316,415,000
明豊ファシリティワークス	8,000	874.00	6,992,000
日本工営	10,400	3,080.00	32,032,000
L I F U L L	52,200	345.00	18,009,000
ミクシィ	42,700	2,807.00	119,858,900
ジェイエシーリクルートメント	11,700	1,814.00	21,223,800
日本M&Aセンター	275,200	3,110.00	855,872,000
メンバーズ	5,100	3,410.00	17,391,000
中広	3,200	360.00	1,152,000
UTグループ	24,300	3,425.00	83,227,500
アイティメディア	5,800	2,079.00	12,058,200
タケエイ	18,900	1,734.00	32,772,600
E・Jホールディングス	9,100	1,095.00	9,964,500
夢真ビーネックスグループ	44,900	1,314.00	58,998,600
コシダカホールディングス	45,300	628.00	28,448,400
アルトナー	4,400	846.00	3,722,400
パソナグループ	18,300	2,338.00	42,785,400
C D S	4,400	1,550.00	6,820,000

リンクアンドモチベーション	30,800	878.00	27,042,400
G C A	22,300	1,091.00	24,329,300
エス・エム・エス	57,100	3,375.00	192,712,500
サニーサイドアップグループ	6,200	738.00	4,575,600
パーソルホールディングス	167,800	2,290.00	384,262,000
リニカル	9,800	989.00	9,692,200
クックパッド	54,000	253.00	13,662,000
アイ・ケイ・ケイ	8,600	680.00	5,848,000
学情	6,200	1,338.00	8,295,600
スタジオアリス	8,600	2,542.00	21,861,200
シミックホールディングス	9,500	1,571.00	14,924,500
エプロ	4,400	875.00	3,850,000
N J S	4,300	1,930.00	8,299,000
総合警備保障	66,800	5,020.00	335,336,000
カカクコム	124,000	3,240.00	401,760,000
アイロムグループ	6,000	2,019.00	12,114,000
セントケア・ホールディング	12,600	985.00	12,411,000
サイネックス	3,300	700.00	2,310,000
ルネサンス	10,700	1,337.00	14,305,900
ディップ	26,300	3,545.00	93,233,500
デジタルホールディングス	11,800	2,233.00	26,349,400
新日本科学	20,800	1,031.00	21,444,800
キャリアデザインセンター	4,500	1,078.00	4,851,000
ベネフィット・ワン	61,100	3,435.00	209,878,500
エムスリー	296,000	7,807.00	2,310,872,000
ツカダ・グローバルホールディング	13,300	385.00	5,120,500
アウトソーシング	96,200	2,138.00	205,675,600
ウェルネット	17,500	525.00	9,187,500
ワールドホールディングス	5,800	3,190.00	18,502,000
ディー・エヌ・エー	71,100	2,264.00	160,970,400
博報堂D Yホールディングス	233,600	1,726.00	403,193,600
ぐるなび	29,800	544.00	16,211,200
タカミヤ	20,900	525.00	10,972,500
ジャパンベストレスキューシステム	11,300	953.00	10,768,900
ファンコミュニケーションズ	46,900	398.00	18,666,200
ライク	4,600	2,147.00	9,876,200
ビジネス・ブレークスルー	7,800	418.00	3,260,400
エスプール	43,400	1,033.00	44,832,200
W D Bホールディングス	7,800	3,050.00	23,790,000
手間いらず	2,200	6,390.00	14,058,000
ティア	10,500	469.00	4,924,500
C D G	1,700	1,590.00	2,703,000

アドウェイズ	27,600	824.00	22,742,400
バリューコマース	11,400	3,115.00	35,511,000
インフォマート	170,000	938.00	159,460,000
J Pホールディングス	49,100	273.00	13,404,300
エコナックホールディングス	34,000	90.00	3,060,000
レグス	4,300	2,631.00	11,313,300
プレステージ・インターナショナル	63,300	734.00	46,462,200
アミューズ	9,300	2,378.00	22,115,400
ドリームインキュベータ	5,400	989.00	5,340,600
クイック	10,700	1,213.00	12,979,100
T A C	10,500	232.00	2,436,000
電通グループ	188,700	4,005.00	755,743,500
イオンファンタジー	6,600	2,154.00	14,216,400
シーティーエス	19,300	835.00	16,115,500
ネクシィーズグループ	6,200	919.00	5,697,800
H . U . グループホールディングス	47,100	2,832.00	133,387,200
アルプス技研	15,000	1,999.00	29,985,000
ダイオーズ	3,600	1,044.00	3,758,400
日本空調サービス	18,000	725.00	13,050,000
オリエンタルランド	178,400	16,090.00	2,870,456,000
ダスキン	39,000	2,568.00	100,152,000
明光ネットワークジャパン	20,200	588.00	11,877,600
ファルコホールディングス	8,200	1,684.00	13,808,800
ラウンドワン	57,400	1,425.00	81,795,000
リゾートトラスト	77,100	1,868.00	144,022,800
ビー・エム・エル	21,700	3,905.00	84,738,500
りらいあコミュニケーションズ	25,700	1,384.00	35,568,800
リソー教育	86,100	333.00	28,671,300
早稲田アカデミー	7,500	934.00	7,005,000
ユー・エス・エス	187,900	1,889.00	354,943,100
東京個別指導学院	15,300	619.00	9,470,700
サイバーエージェント	413,500	2,329.00	963,041,500
楽天グループ	783,900	1,328.00	1,041,019,200
クリーク・アンド・リバー社	9,000	1,713.00	15,417,000
モーニングスター	25,100	470.00	11,797,000
テー・オー・ダブリュー	30,300	321.00	9,726,300
山田コンサルティンググループ	10,000	1,200.00	12,000,000
セントラルスポーツ	6,400	2,450.00	15,680,000
フルキャストホールディングス	14,400	2,300.00	33,120,000
エン・ジャパン	29,900	3,920.00	117,208,000
リソルホールディングス	1,900	3,985.00	7,571,500
テクノプロ・ホールディングス	100,600	2,735.00	275,141,000

アトラグループ	3,900	331.00	1,290,900
インターワークス	5,600	415.00	2,324,000
アイ・アールジャパンホールディングス	6,800	14,460.00	98,328,000
K e e P e r 技研	10,900	3,005.00	32,754,500
ファーストロジック	3,700	790.00	2,923,000
三機サービス	3,600	1,077.00	3,877,200
G u n o s y	10,800	921.00	9,946,800
デザインワン・ジャパン	5,500	245.00	1,347,500
イー・ガーディアン	6,900	2,814.00	19,416,600
リブセンス	10,700	220.00	2,354,000
ジャパンマテリアル	51,800	1,352.00	70,033,600
ベクトル	21,200	945.00	20,034,000
ウチヤマホールディングス	9,100	372.00	3,385,200
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,196.00	15,189,200
キャリアリンク	5,600	2,093.00	11,720,800
I B J	14,000	1,155.00	16,170,000
アサンテ	6,200	1,764.00	10,936,800
バリューHR	6,900	1,677.00	11,571,300
M & A キャピタルパートナーズ	13,900	5,660.00	78,674,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,397.00	9,359,900
E R I ホールディングス	5,200	654.00	3,400,800
アビスト	2,700	2,988.00	8,067,600
シグマクシス	9,300	2,359.00	21,938,700
ウィルグループ	12,600	1,010.00	12,726,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	26,100	250.00	6,525,000
メドピア	13,000	4,445.00	57,785,000
レアジョブ	3,300	1,700.00	5,610,000
リクルートホールディングス	1,201,500	5,709.00	6,859,363,500
エラン	23,400	1,273.00	29,788,200
土木管理総合試験所	9,000	399.00	3,591,000
ネットマーケティング	8,900	401.00	3,568,900
日本郵政	1,269,400	921.50	1,169,752,100
ベルシステム24ホールディングス	28,300	1,792.00	50,713,600
鎌倉新書	17,200	1,007.00	17,320,400
S M N	4,000	797.00	3,188,000
グローバルキッズCOMPANY	3,400	986.00	3,352,400
エアトリ	10,600	2,783.00	29,499,800
アトラエ	11,800	2,311.00	27,269,800
ストライク	6,400	3,780.00	24,192,000
ソラスト	41,400	1,411.00	58,415,400
セラク	5,400	2,176.00	11,750,400
インソース	16,400	2,557.00	41,934,800

ベイカレント・コンサルティング	11,000	35,750.00	393,250,000
Orchestra Holdings	3,800	2,995.00	11,381,000
アイモバイル	5,000	1,573.00	7,865,000
キャリアインデックス	7,200	935.00	6,732,000
MS - Japan	7,100	1,227.00	8,711,700
船場	3,700	833.00	3,082,100
グレイステクノロジー	17,200	1,574.00	27,072,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,500	2,561.00	124,208,500
フルテック	2,600	1,369.00	3,559,400
GameWith	5,500	589.00	3,239,500
ソウルドアウト	4,200	1,773.00	7,446,600
MS&Consulting	3,200	601.00	1,923,200
ウェルビー	6,400	1,362.00	8,716,800
エル・ティー・エス	1,700	4,080.00	6,936,000
ミダック	7,400	4,340.00	32,116,000
日総工産	13,500	834.00	11,259,000
キュービーネットホールディングス	7,900	1,672.00	13,208,800
RPAホールディングス	20,600	779.00	16,047,400
スプリックス	5,000	1,200.00	6,000,000
マネジメントソリューションズ	8,300	2,889.00	23,978,700
プロレド・パートナーズ	3,200	2,797.00	8,950,400
テノ・ホールディングス	2,100	1,184.00	2,486,400
フロンティア・マネジメント	4,000	1,140.00	4,560,000
ピアラ	1,500	1,043.00	1,564,500
コプロ・ホールディングス	2,400	1,376.00	3,302,400
ギークス	3,000	1,888.00	5,664,000
カーブスホールディングス	46,400	982.00	45,564,800
フォーラムエンジニアリング	12,000	935.00	11,220,000
ダイレクトマーケティングミックス	9,000	3,930.00	35,370,000
ポピンズホールディングス	4,500	4,640.00	20,880,000
LITALICO	6,800	5,440.00	36,992,000
アドバンテッジリスクマネジメント	8,800	1,106.00	9,732,800
リログループ	91,800	2,474.00	227,113,200
東祥	10,600	1,961.00	20,786,600
エイチ・アイ・エス	26,800	2,600.00	69,680,000
ラックランド	4,900	2,702.00	13,239,800
共立メンテナンス	27,900	3,875.00	108,112,500
イチネンホールディングス	17,700	1,237.00	21,894,900
建設技術研究所	10,900	2,345.00	25,560,500
スペース	11,200	900.00	10,080,000
長大	6,800	1,945.00	13,226,000
燦ホールディングス	7,600	1,239.00	9,416,400

スバル興業	1,100	8,170.00	8,987,000	
東京テアトル	6,600	1,258.00	8,302,800	
タナベ経営	3,400	1,422.00	4,834,800	
ナガワ	5,400	8,710.00	47,034,000	
東京都競馬	11,000	4,540.00	49,940,000	
カナモト	29,700	2,564.00	76,150,800	
西尾レントオール	15,600	3,075.00	47,970,000	
トランス・コスモス	16,100	3,115.00	50,151,500	
乃村工藝社	72,200	885.00	63,897,000	
藤田観光	6,700	2,308.00	15,463,600	
KNT-CTホールディングス	8,900	1,318.00	11,730,200	
日本管財	18,100	2,567.00	46,462,700	
トーカイ	16,300	2,426.00	39,543,800	
セコム	165,300	8,521.00	1,408,521,300	
セントラル警備保障	8,200	3,070.00	25,174,000	
丹青社	32,000	882.00	28,224,000	
メイテック	20,300	6,210.00	126,063,000	
応用地質	19,100	1,304.00	24,906,400	
船井総研ホールディングス	34,500	2,497.00	86,146,500	
進学会ホールディングス	7,300	424.00	3,095,200	
オオバ	12,200	826.00	10,077,200	
いであ	4,300	1,807.00	7,770,100	
学究社	5,100	1,363.00	6,951,300	
ベネッセホールディングス	61,600	2,753.00	169,584,800	
イオンディライト	20,800	3,640.00	75,712,000	
ナック	8,300	915.00	7,594,500	
ダイセキ	28,200	4,895.00	138,039,000	
ステップ	6,300	1,675.00	10,552,500	
合 計	184,040,800		470,454,256,330	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 日本債券ツイン戦略マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,009,913,621
国債証券	16,897,865,900
社債券	48,771,097,000
コール・オプション（買）	4,465,000
プット・オプション（買）	19,345,000
未収入金	698,519,000
未収利息	107,943,349
前払金	5,100,000
前払費用	10,208,593
差入委託証拠金	4,500,000
流動資産合計	67,528,957,463
資産合計	67,528,957,463
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	15,090,000
プット・オプション（売）	5,683,000
派生商品評価勘定	5,101,980
未払金	300,000,000
未払解約金	2,488,987
未払利息	1,541
流動負債合計	328,365,508
負債合計	328,365,508
純資産の部	
元本等	
元本	67,304,440,043
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	103,848,088
元本等合計	67,200,591,955
純資産合計	67,200,591,955
負債純資産合計	67,528,957,463

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p>



2021年 7月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> <p>(2)債券店頭オプション取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	67,304,440,043口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 103,848,088円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9985円 (1万口当たり純資産額) (9,985円)

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2021年 7月12日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引、債券店頭オプション取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。債券店頭オプション取引に係る主要なリスクは、オプション相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

	2021年 7月12日現在

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	31,218,365,178円
期中追加設定元本額	42,024,918,927円
期中一部解約元本額	5,938,844,062円
期末元本額	67,304,440,043円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,995,188,157円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,148,854,615円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	43,963,326,688円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,335,832,972円
債券コア戦略ファンド	705,054,464円
債券コア・セレクション	3,996,512,029円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	201,073,191円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	23,577,601円
日本債券ツイン戦略ファンド（SMA専用）	202,686,918円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	464,315,281円
FOFs用 日本債券ツイン戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	1,343,432,967円
私募日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	6,924,585,160円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		202,052,300
社債券		350,582,000
合計		552,634,300

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券ツイン戦略マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 売建	908,040,000	-	913,140,000	5,100,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引 買建				
	コール	4,820,796,000	-	4,465,000	4,417,000
	プット	3,221,959,000	-	19,345,000	2,363,000
	売建				
	コール	3,221,959,000	-	15,090,000	2,616,000
	プット	4,820,796,000	-	5,683,000	4,352,000
	合計	16,993,550,000	-	957,723,000	5,288,000

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1)株式

該当事項はありません。

###### (2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第2回利付国債(40年)	410,000,000	575,996,700	
	第4回利付国債(40年)	150,000,000	212,076,000	
	第12回利付国債(40年)	550,000,000	510,350,500	
	第13回利付国債(40年)	200,000,000	185,006,000	
	第351回利付国債(10年)	300,000,000	304,509,000	
	第361回利付国債(10年)	100,000,000	100,943,000	
	第362回利付国債(10年)	550,000,000	554,521,000	
	第6回利付国債(30年)	200,000,000	248,678,000	
	第18回利付国債(30年)	300,000,000	385,974,000	
	第29回利付国債(30年)	100,000,000	134,767,000	
	第31回利付国債(30年)	230,000,000	304,584,400	
	第34回利付国債(30年)	150,000,000	200,550,000	
	第35回利付国債(30年)	100,000,000	130,375,000	
	第37回利付国債(30年)	280,000,000	361,687,200	
	第41回利付国債(30年)	450,000,000	566,370,000	
	第46回利付国債(30年)	200,000,000	243,902,000	
	第47回利付国債(30年)	290,000,000	360,507,700	
	第48回利付国債(30年)	80,000,000	95,950,400	
	第51回利付国債(30年)	420,000,000	396,538,800	
	第52回利付国債(30年)	420,000,000	415,350,600	
	第55回利付国債(30年)	80,000,000	84,539,200	
	第58回利付国債(30年)	290,000,000	305,448,300	
	第61回利付国債(30年)	90,000,000	92,228,400	
	第64回利付国債(30年)	470,000,000	442,533,200	
	第65回利付国債(30年)	70,000,000	65,799,300	
	第67回利付国債(30年)	100,000,000	98,782,000	
	第69回利付国債(30年)	520,000,000	525,772,000	
	第70回利付国債(30年)	1,650,000,000	1,666,368,000	
	第147回利付国債(20年)	440,000,000	519,807,200	
	第150回利付国債(20年)	200,000,000	232,332,000	
	第152回利付国債(20年)	250,000,000	284,437,500	
	第158回利付国債(20年)	190,000,000	197,527,800	
	第160回利付国債(20年)	460,000,000	491,238,600	
	第163回利付国債(20年)	510,000,000	535,642,800	
第165回利付国債(20年)	500,000,000	515,700,000		
第169回利付国債(20年)	800,000,000	793,248,000		
第171回利付国債(20年)	360,000,000	355,647,600		
第172回利付国債(20年)	270,000,000	271,177,200		
第173回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,052,772,000		
第174回利付国債(20年)	500,000,000	500,445,000		
第175回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,476,143,500		

	第176回利付国債（20年）	100,000,000	101,639,000	
	国債証券合計	15,830,000,000	16,897,865,900	
社債券	第6回みずほFG任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	1,000,000,000	1,010,300,000	
	第8回みずほFG任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	600,000,000	604,674,000	
	第2回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約）	100,000,000	102,358,000	
	第3回野村ホールディングス任意償還・無担保永久社債（劣後特約）	800,000,000	808,912,000	
	第1回大和証券任意償還・無担保永久社債（劣後特約付）	100,000,000	99,644,000	
	第5回A号太陽生命利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	700,014,000	
	第3回第一生命HD利払繰延・任意償還付永久社債（劣後）	500,000,000	510,470,000	
	第1回大樹生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	402,164,000	
	第2回DMG森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	200,000,000	200,324,000	
	第3回DMG森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	300,000,000	317,508,000	
	第8回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	300,000,000	301,179,000	
	第7回クレディ・アグリコル期限前償還非上位円貨社債	200,000,000	206,172,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	200,000,000	200,882,000	
	第23回ルノー円貨社債	1,000,000,000	1,000,740,000	
	第24回ルノー円貨社債	500,000,000	500,580,000	
	第14回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	201,832,000	
	第16回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	200,000,000	200,758,000	
	第1回大和ハウス工業利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	400,476,000	
	第1回積水ハウス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	703,444,000	
	ソシエテ・ジェネラル 0.472% 2025/02/27	200,000,000	199,066,000	
	BNPパリバ 0.557% 2027/05/20	1,000,000,000	1,001,680,000	
	第1回アサヒグループHD利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	1,019,020,000	
	第1回サントリーHD利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	400,000,000	401,700,000	
	第3回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	201,030,000	
第1回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	300,000,000	300,639,000		
第2回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	100,552,000		

第2回ヒューリック利払繰延・期限前償還 (劣後特約付)	300,000,000	306,555,000	
第3回ヒューリック利払繰延・期限前償還 (劣後特約付)	300,000,000	308,085,000	
第4回ヒューリック利払繰延・期限前償還 (劣後特約付)	100,000,000	104,044,000	
第10回J・フロント リテイリング株式会 社無担保社債	100,000,000	100,536,000	
第10回日本プロロジスリート投資法人無担 保投資法人債	100,000,000	100,238,000	
第11回日本プロロジスリート投資法人無担 保投資法人債	200,000,000	201,084,000	
第1回東急不動産ホールディングス利払繰 延・期限前償還(劣後特)	200,000,000	203,170,000	
第2回東急不動産ホールディングス利払繰 延・期限前償還(劣後特)	300,000,000	306,816,000	
第5回日本土地建物株式会社無担保社債	100,000,000	99,067,000	
第40回王子ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	100,659,000	
第4回株式会社マクロミル無担保社債	400,000,000	400,596,000	
第1回住友化学利払繰延・期限前償還(劣後 特約付)	400,000,000	416,488,000	
第2回住友化学利払繰延・期限前償還(劣後 特約付)	600,000,000	604,422,000	
第16回株式会社ダイセル無担保社債	100,000,000	101,208,000	
第17回株式会社ダイセル無担保社債	100,000,000	101,740,000	
第1回積水化成工業株式会社無担保社債	300,000,000	300,012,000	
第1回大日本住友製薬利払繰延・期限前償還 (劣後特約付)	300,000,000	310,044,000	
第2回大日本住友製薬利払繰延・期限前償還 (劣後特約付)	300,000,000	313,128,000	
第14回Zホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	100,017,000	
第15回Zホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	100,192,000	
第17回Zホールディングス株式会社無担保 社債	300,000,000	303,786,000	
第1回楽天利払繰延・期限前償還(劣後特約 付)	100,000,000	104,368,000	
第4回楽天利払繰延・期限前償還(劣後特約 付)	1,200,000,000	1,235,328,000	
第6回楽天利払繰延・期限前償還(劣後特約 付)	200,000,000	225,508,000	
第1回ENEOSホールディングス利払繰 延・期限前償還(劣後)	500,000,000	502,750,000	
第2回ENEOSホールディングス利払繰 延・期限前償還(劣後)	600,000,000	610,470,000	
第3回ENEOSホールディングス利払繰 延・期限前償還(劣後)	800,000,000	824,104,000	
第1回JFEホールディングス利払繰延・期 限前償還(劣後特約付)	400,000,000	401,236,000	
	300,000,000	300,522,000	

第2回株式会社小森コーポレーション無担保社債			
第10回日本トムソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,099,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	100,655,000	
第2回かんぽ生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	203,862,000	
第1回アイシン精機利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	299,565,000	
第1回住友生命第1回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	400,000,000	400,124,000	
第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	300,000,000	300,099,000	
第3回楽天カード株式会社無担保社債	200,000,000	199,586,000	
第1回日本生命第5回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	600,000,000	614,898,000	
第1回住友生命第2回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	300,000,000	308,316,000	
第1回日本生命第6回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	500,000,000	509,050,000	
第2回シークス株式会社無担保社債	100,000,000	100,233,000	
第1回N I S S H A 株式会社無担保社債	100,000,000	100,122,000	
第1回丸紅利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	202,212,000	
第1回ニプロ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	306,711,000	
第86回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,769,000	
第87回株式会社クレディセゾン無担保社債	200,000,000	201,134,000	
第7回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	600,000,000	619,800,000	
第12回株式会社新生銀行無担保社債	200,000,000	200,964,000	
第20回みずほフィナンシャルグループ期限前償還（劣後特約付）	700,000,000	700,511,000	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	400,000,000	401,944,000	
第17回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,856,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,702,000	
第2回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	507,720,000	
第3回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	311,418,000	
第32回東京センチュリー株式会社無担保社債	200,000,000	199,440,000	
第33回東京センチュリー株式会社無担保社債	200,000,000	200,738,000	
第17回S B Iホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	500,270,000	
第19回S B Iホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,128,000	
	200,000,000	200,900,000	



第21回SBIホールディングス株式会社無担保社債			
第23回SBIホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	401,704,000	
第24回SBIホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	403,684,000	
第10回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	300,000,000	299,973,000	
第28回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	200,000,000	203,346,000	
第1回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	300,000,000	298,239,000	
第2回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	199,068,000	
第201回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,768,000	
第2回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,162,000	
第1回MS&ADインシュアランス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,000,000,000	1,003,330,000	
第1回東京海上日動火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	2,000,000,000	2,042,060,000	
第3回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	503,000,000	
第5回三井住友海上火災保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1,200,000,000	1,226,928,000	
第1回あいおいニッセイ同和損害保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	500,000,000	501,445,000	
第2回T&Dホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	100,258,000	
第3回T&Dホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	100,148,000	
第5回三菱地所株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	200,728,000	
第6回三菱地所株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	100,000,000	102,382,000	
第40回平和不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,090,000	
第3回東京建物利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	200,000,000	201,648,000	
第32回東京建物株式会社無担保社債	100,000,000	100,304,000	
第26回イオンモール株式会社無担保社債	400,000,000	401,220,000	
第1回株式会社東祥無担保社債	100,000,000	100,279,000	
第1回日本都市ファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,240,000	
第17回オリックス不動産投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,240,000	
第7回日本ロジスティクスファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	99,954,000	
第167回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	296,016,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	312,354,000	
第76回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	199,000,000	

第77回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	196,382,000	
第1回西日本鉄道株式会社利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	200,000,000	200,040,000	
第2回西日本鉄道株式会社利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	100,000,000	100,075,000	
第1回商船三井利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	400,000,000	411,168,000	
第10回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	100,124,000	
第4回株式会社ヤマタネ無担保社債	300,000,000	300,150,000	
第3回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	301,095,000	
第9回ソフトバンク株式会社無担保社債	600,000,000	603,948,000	
第12回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	300,909,000	
第13回ソフトバンク株式会社無担保社債	300,000,000	301,137,000	
第28回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	207,328,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	101,603,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	100,368,000	
第34回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	200,736,000	
第1回GMOインターネット無担保社債	200,000,000	200,034,000	
第2回GMOインターネット無担保社債	200,000,000	200,200,000	
第529回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,904,000	
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	205,212,000	
第11回東京電力パワーグリッド株式会社社債	700,000,000	714,224,000	
第25回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	207,094,000	
第35回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	209,748,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	700,000,000	710,479,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,049,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	500,000,000	502,025,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	303,582,000	
第46回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	203,784,000	
第13回コナミホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,363,000	
第3回株式会社バローホールディングス無担保社債	100,000,000	100,123,000	
第1回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,601,000	
第2回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債(劣後特約付)	300,000,000	302,451,000	
第3回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	790,000,000	792,054,000	
第4回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	200,000,000	205,006,000	

第48回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	600,000,000	610,416,000	
社債券合計	48,190,000,000	48,771,097,000	
合計		65,668,962,900	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	9,020,072,467
コール・ローン	462,251,836
株式	508,808,969,774
投資信託受益証券	308,071,067
投資証券	11,835,425,758
派生商品評価勘定	249,819,571
未収入金	1,503,700
未収配当金	378,733,681
差入委託証拠金	3,500,964,135
流動資産合計	534,565,811,989
資産合計	534,565,811,989
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,787,065
前受金	222,995,129
未払金	647,594
未払解約金	359,433,251
未払利息	705
流動負債合計	609,863,744
負債合計	609,863,744
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	137,442,391,078
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	396,513,557,167
元本等合計	533,955,948,245
純資産合計	533,955,948,245
負債純資産合計	534,565,811,989

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p>

	2021年 7月12日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,442,391,078口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.8849円 (1万口当たり純資産額) (38,849円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

	2021年 7月12日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	150,285,284,851円
期中追加設定元本額	18,234,274,317円
期中一部解約元本額	31,077,168,090円
期末元本額	137,442,391,078円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,001,406,518円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,331,893円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,876,434,113円
世界経済インデックスファンド	8,547,243,595円
外国株式インデックス・オープン	825,570,999円
D C マイセレクション 2 5	844,802,816円
D C マイセレクション 5 0	4,033,137,357円
D C マイセレクション 7 5	4,496,571,805円
D C 外国株式インデックス・オープン	11,103,954,181円
D C マイセレクション S 2 5	407,977,046円
D C マイセレクション S 5 0	1,888,439,666円
D C マイセレクション S 7 5	1,487,974,575円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	68,758,692円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	185,340,786円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	130,628,490円
D C 世界経済インデックスファンド	10,066,044,781円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,838,874,226円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,345,507円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	5,085,097円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	30,705,658円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	24,672,922円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	88,492,989円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	14,696,140円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	47,259,488円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	386,385,088円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	216,808,865円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,565,927,676円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	548,489,178円

区分	2021年 7月12日現在
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	42,014,656円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	208,460,816円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	72,760,304円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,233,470,256円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,381,308,862円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,128,481,876円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,244,951,979円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,587,531,564円
分散投資コア戦略ファンドA	1,876,550,513円
分散投資コア戦略ファンドS	9,350,780,542円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,307,478,553円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,152,455,706円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,025,879,041円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	638,825,685円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	30,983,860円
SMT インデックスバランス・オープン	171,672,657円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	704,178,481円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	26,606,548,980円
SMT 世界経済インデックス・オープン	162,076,375円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	553,432,498円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	101,637,381円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,382,730円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	112,255,264円
グローバル経済コア	682,428,715円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,653,306円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	4,607,222円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	664,326,699円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	74,667,735円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	12,842,844円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	8,707,619円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	4,100,299円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,668,613円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	573,562,496円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	868,719,467円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,292,498,999円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	802,652,216円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	125,840,782円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	5,394,645円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	286,317,818円
SMTAMバランスファンド2002（適格機関投資家専用）	441,289,364円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	294,802,711円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	284,799,149円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	282,822,494円



区分	2021年 7月12日現在
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	275,209,159円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	17,098,547,422	
投資信託受益証券	13,514,806	
投資証券	683,505,358	
合計	17,795,567,586	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,058,845,866	-	13,281,840,995	222,995,129
合計		13,058,845,866	-	13,281,840,995	222,995,129

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	418,338,960	-	418,376,337	37,377
	アメリカドル	220,320,000	-	220,334,800	14,800
	ユーロ	52,321,600	-	52,328,760	7,160
	スイスフラン	51,820,160	-	51,820,977	817

スウェーデンク ローナ	41,107,200	-	41,120,000	12,800
デンマーククロー ネ	52,770,000	-	52,771,800	1,800
合計	418,338,960	-	418,376,337	37,377

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	57,980	22.73	1,317,885.40	
	CHENIERE ENERGY INC	19,034	88.01	1,675,182.34	
	CHEVRON CORP	166,092	104.07	17,285,194.44	
	CONOCOPHILLIPS	117,327	60.13	7,054,872.51	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,000	28.65	1,633,050.00	
	EOG RESOURCES INC	51,325	82.59	4,238,931.75	
	EXXON MOBIL	365,193	61.23	22,360,767.39	
	HALLIBURTON CO	77,539	22.38	1,735,322.82	
	HESS CORP	24,844	84.01	2,087,144.44	
	KINDER MORGAN INC	179,427	18.67	3,349,902.09	
	MARATHON PETROLEUM CORP	57,189	58.68	3,355,850.52	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,106	30.24	2,392,165.44	
	ONEOK INC	37,709	57.52	2,169,021.68	
	PHILLIPS 66	38,113	82.70	3,151,945.10	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,954	158.00	2,836,732.00	
	SCHLUMBERGER	122,666	31.19	3,825,952.54	
	VALERO ENERGY CORP	34,683	72.30	2,507,580.90	
	WILLIAMS COS	104,984	26.70	2,803,072.80	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	19,118	291.67	5,576,147.06	
	ALBEMARLE CORP	10,180	175.51	1,786,691.80	
AMCOR PLC	132,975	11.51	1,530,542.25		
AVERY DENNISON CORP	7,457	210.35	1,568,579.95		
BALL CORP	27,925	84.79	2,367,760.75		

CELANESE CORP-SERIES A	9,842	153.53	1,511,042.26
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	19,071	50.66	966,136.86
CORTEVA INC	64,900	43.45	2,819,905.00
CROWN HOLDINGS INC	11,212	105.57	1,183,650.84
DOW INC	63,659	63.08	4,015,609.72
DUPONT DE NEMOURS INC	46,139	78.48	3,620,988.72
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,641	114.95	1,453,082.95
ECOLAB INC	22,189	212.76	4,720,931.64
FMC CORP	12,118	107.66	1,304,623.88
FREEMPORT-MCMORAN INC	125,342	36.50	4,574,983.00
INT'L PAPER CO	33,803	62.24	2,103,898.72
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21,184	147.70	3,128,876.80
LINDE PLC	45,090	292.71	13,198,293.90
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,673	102.73	2,329,197.29
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,321	357.92	1,904,492.32
MOSAIC CO/THE	31,911	31.79	1,014,450.69
NEWMONT CORPORATION	68,576	63.98	4,387,492.48
NUCOR CORP	25,565	97.17	2,484,151.05
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,890	138.63	1,232,420.70
PPG INDUSTRIES INC	20,538	171.41	3,520,418.58
RPM INTERNATIONAL INC	12,430	90.52	1,125,163.60
SEALED AIR CORP	14,689	58.40	857,837.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21,917	276.22	6,053,913.74
STEEL DYNAMICS INC	18,273	61.50	1,123,789.50
VULCAN MATERIALS CO	11,347	174.93	1,984,930.71
WESTROCK CO	24,734	52.87	1,307,686.58
3 M COMPANY	50,115	201.00	10,073,115.00
ALLEGION PLC	7,601	138.27	1,050,990.27
AMETEK INC	19,666	135.47	2,664,153.02
BOEING CO	47,686	239.59	11,425,088.74
CARRIER GLOBAL CORP	70,603	48.27	3,408,006.81
CATERPILLAR	47,231	217.42	10,268,964.02
CUMMINS INC	12,914	242.70	3,134,227.80
DEERE&CO	25,864	349.48	9,038,950.72
DOVER CORP	12,202	153.46	1,872,518.92
EATON CORP	34,431	153.56	5,287,224.36
EMERSON ELECTRIC CO	51,393	97.61	5,016,470.73
FASTENAL CO	48,796	53.84	2,627,176.64
FORTIVE CORP	25,722	70.68	1,818,030.96
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,810	98.49	1,261,656.90
GENERAC HOLDINGS INC	5,800	436.37	2,530,946.00
GENERAL DYNAMICS CORP	21,212	190.22	4,034,946.64

GENERAL ELECTRIC CO	761,269	13.16	10,018,300.04
GRAINGER (WW) INC	3,846	456.83	1,756,968.18
HEICO CORP	3,640	142.20	517,608.00
HEICO CORP-CLASS A	6,449	130.22	839,788.78
HONEYWELL INTL INC	59,921	224.34	13,442,677.14
HOWMET AEROSPACE INC	36,550	33.95	1,240,872.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	206.22	726,306.84
IDEX CORP	6,916	224.27	1,551,051.32
ILLINOIS TOOL WORKS	27,403	227.38	6,230,894.14
INGERSOLL-RAND INC	31,562	49.38	1,558,531.56
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	20,100	63.93	1,284,993.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	63,375	70.06	4,440,052.50
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,086	223.99	4,051,083.14
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,062	342.15	1,047,663.30
LOCKHEED MARTIN CORP	21,652	383.11	8,295,097.72
MASCO CORP	23,467	58.45	1,371,646.15
NORDSON CORP	4,880	221.30	1,079,944.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,571	371.82	5,045,969.22
OTIS WORLDWIDE CORP	35,040	83.82	2,937,052.80
OWENS CORNING	8,642	96.35	832,656.70
PACCAR INC	30,155	87.50	2,638,562.50
PARKER HANNIFIN CORP	11,234	311.57	3,500,177.38
PENTAIR PLC	14,533	69.30	1,007,136.90
PLUG POWER INC	41,884	29.39	1,230,970.76
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	131,986	86.38	11,400,950.68
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,938	291.20	2,893,945.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,326	481.18	4,487,484.68
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	57.74	798,428.72
SMITH (A.O.) CORP	12,146	70.75	859,329.50
SNAP-ON INC	4,900	227.65	1,115,485.00
STANLEY BLACK&DECKER	13,718	208.53	2,860,614.54
SUNRUN INC	13,917	52.58	731,755.86
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	426.79	1,664,054.21
TEXTRON	18,893	67.70	1,279,056.10
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,642	190.32	3,928,585.44
TRANSDIGM GROUP INC	4,425	660.06	2,920,765.50
UNITED RENTALS INC	6,103	317.48	1,937,580.44
WABTEC CORP	15,024	82.85	1,244,738.40
XYLEM INC	15,209	121.05	1,841,049.45
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	88.80	1,009,123.20
CINTAS CORP	8,043	388.32	3,123,257.76
CLARIVATE PLC	27,357	26.34	720,583.38

COPART INC	18,067	138.49	2,502,098.83
COSTAR GROUP INC	34,030	86.28	2,936,108.40
EQUIFAX INC	10,409	248.54	2,587,052.86
IHS MARKIT LTD	32,602	113.52	3,700,979.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,026	134.65	1,619,300.90
LEIDOS HOLDINGS	11,220	104.84	1,176,304.80
REPUBLIC SERVICES INC	20,007	112.67	2,254,188.69
ROBERT HALF INTL INC	9,566	88.45	846,112.70
ROLLINS INC	21,849	35.39	773,236.11
TRANSUNION	17,091	113.84	1,945,639.44
VERISK ANALYTICS INC	13,390	181.71	2,433,096.90
WASTE CONNECTIONS INC	22,454	122.14	2,742,531.56
WASTE MANAGEMENT INC	36,263	143.04	5,187,059.52
AMERCO	1,000	584.00	584,000.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,292	93.17	1,052,075.64
CSX CORP	197,466	31.83	6,285,342.78
DELTA AIR LINES INC	14,609	42.92	627,018.28
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,272	128.40	1,832,524.80
FEDEX CORP	21,597	296.40	6,401,350.80
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	165.78	1,169,080.56
KANSAS CITY SOUTHERN	7,965	273.95	2,182,011.75
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10,700	49.78	532,646.00
LYFT INC-A	21,288	60.06	1,278,557.28
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,987	263.64	5,796,652.68
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,003	260.58	2,085,421.74
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	52.84	715,083.72
UBER TECHNOLOGIES INC	103,109	49.07	5,059,558.63
UNION PACIFIC CORP	57,701	221.69	12,791,734.69
UNITED PARCEL SERVICE B	62,170	213.92	13,299,406.40
XPO LOGISTICS INC	8,001	141.10	1,128,941.10
APTIV PLC	23,540	155.61	3,663,059.40
AUTOLIV INC	6,776	96.04	650,767.04
BORGWARNER INC	19,781	47.80	945,531.80
FORD MOTOR COMPANY	334,463	14.48	4,843,024.24
GENERAL MOTORS CO	114,044	58.76	6,701,225.44
LEAR CORP	5,287	174.03	920,096.61
TESLA INC	66,189	656.95	43,482,863.55
DR HORTON INC	29,632	89.57	2,654,138.24
GARMIN LTD	12,854	148.81	1,912,803.74
HASBRO INC	12,468	97.98	1,221,614.64
LENNAR CORP-CL A	24,928	98.93	2,466,127.04
LULULEMON ATHLETICA INC	10,777	377.42	4,067,455.34

MOHAWK INDUSTRIES INC	5,062	198.95	1,007,084.90
NEWELL BRANDS INC	31,461	27.03	850,390.83
NIKE B	109,235	161.00	17,586,835.00
NVR INC	297	5,060.84	1,503,069.48
PELOTON INTERACTIVE INC-A	21,736	117.84	2,561,370.24
PULTE GROUP INC	24,818	53.23	1,321,062.14
VF CORP	28,638	83.07	2,378,958.66
WHIRLPOOL CORP	5,220	225.02	1,174,604.40
AIRBNB INC-CLASS A	4,665	149.64	698,070.60
ARAMARK	20,955	35.92	752,703.60
BOOKING HOLDINGS INC	3,556	2,194.99	7,805,384.44
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	96.86	1,700,861.60
CARNIVAL CORPORATION	70,520	24.26	1,710,815.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,399	1,592.25	3,819,807.75
DARDEN RESTAURANTS INC	12,063	148.58	1,792,320.54
DOMINO'S PIZZA INC	3,251	477.56	1,552,547.56
DRAFTKINGS INC - CL A	15,674	49.09	769,436.66
EXPEDIA GROUP INC	11,638	167.74	1,952,158.12
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23,788	126.05	2,998,477.40
LAS VEGAS SANDS CORP	29,370	51.33	1,507,562.10
MARRIOTT INTL A	24,361	142.48	3,470,955.28
MCDONALD'S CORP	64,866	235.68	15,287,618.88
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	17,662	16.12	284,711.44
MGM RESORTS INTERNATIONAL	33,064	41.60	1,375,462.40
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,267	82.33	1,586,252.11
STARBUCKS CORP	102,054	117.47	11,988,283.38
VAIL RESORTS INC	3,574	325.63	1,163,801.62
WYNN RESORTS LTD	9,302	113.87	1,059,218.74
YUM BRANDS INC	25,844	118.58	3,064,581.52
ACTIVISION BLIZZARD INC	66,954	92.38	6,185,210.52
ALPHABET INC-CL A	25,977	2,510.37	65,211,881.49
ALPHABET INC-CL C	25,465	2,591.49	65,992,292.85
ALTICE USA INC- A	22,505	34.80	783,174.00
CABLE ONE INC	445	1,933.00	860,185.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	11,659	736.47	8,586,503.73
COMCAST CORP-CL A	394,334	58.03	22,883,202.02
DISCOVERY INC - A	12,804	29.30	375,157.20
DISCOVERY INC-C	28,190	27.77	782,836.30
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	41.50	835,478.00
ELECTRONIC ARTS INC	24,944	140.99	3,516,854.56
FACEBOOK INC-A	207,790	350.42	72,813,771.80
FOX CORP - CLASS A	27,658	36.45	1,008,134.10

FOX CORP- CLASS B	15,092	34.51	520,824.92
IAC/INTERACTIVECORP	6,721	144.15	968,832.15
INTERPUBLIC GROUP OF COS	33,834	33.08	1,119,228.72
LIBERTY BROADBAND-A	2,579	172.67	445,315.93
LIBERTY BROADBAND-C	13,516	178.64	2,414,498.24
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,693	48.88	913,713.84
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17,264	46.52	803,121.28
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	46.89	299,345.76
LIVE NATION ENTERTAINMENT	13,908	83.66	1,163,543.28
MATCH GROUP INC	21,851	162.63	3,553,628.13
NETFLIX INC	38,504	535.98	20,637,373.92
NEWS CORP-CLASS A	33,479	25.52	854,384.08
OMNICOM GROUP	18,031	80.05	1,443,381.55
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	76.99	3,523,601.33
ROKU INC	9,741	431.61	4,204,313.01
SEA LTD-ADR	638	275.70	175,896.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	99,548	6.56	653,034.88
SNAP INC - A	81,742	65.81	5,379,441.02
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,738	170.37	1,659,063.06
THE WALT DISNEY CO	156,656	177.04	27,734,378.24
TWITTER INC	70,140	68.97	4,837,555.80
VIACOMCBS INC-CLASS B	48,586	42.77	2,078,023.22
ZILLOW GROUP INC-A	5,497	116.59	640,895.23
ZILLOW GROUP INC-C	13,427	115.29	1,547,998.83
ADVANCE AUTO PARTS	6,186	213.47	1,320,525.42
AMAZON.COM	36,986	3,719.34	137,563,509.24
AUTOZONE INC	1,986	1,564.53	3,107,156.58
BEST BUY COMPANY INC	19,870	110.86	2,202,788.20
BURLINGTON STORES INC	5,808	329.89	1,916,001.12
CARMAX INC	13,891	134.84	1,873,062.44
CARVANA CO	5,700	323.42	1,843,494.00
CHEWY INC - CLASS A	6,878	85.57	588,550.46
DOLLAR GENERAL CORP	20,962	220.77	4,627,780.74
DOLLAR TREE INC	20,151	99.51	2,005,226.01
EBAY	59,339	69.46	4,121,686.94
ETSY INC	11,000	195.09	2,145,990.00
GENUINE PARTS CO	12,119	129.52	1,569,652.88
HOME DEPOT	92,922	322.09	29,929,246.98
L BRANDS INC	19,806	73.50	1,455,741.00
LKQ CORP	26,705	50.97	1,361,153.85
LOWES COMPANIES	63,738	195.33	12,449,943.54
MERCADOLIBRE INC	3,877	1,554.97	6,028,618.69

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,067	591.65	3,589,540.55
POOL CORP	3,700	476.24	1,762,088.00
ROSS STORES INC	31,643	124.77	3,948,097.11
TARGET (DAYTON HUDSON)	43,484	248.58	10,809,252.72
TJX COMPANIES INC	103,121	68.36	7,049,351.56
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,932	186.91	1,856,390.12
ULTA BEAUTY INC	4,520	343.65	1,553,298.00
WAYFAIR INC- CLASS A	6,000	303.90	1,823,400.00
COSTCO WHOLESALE CORP	38,401	412.37	15,835,420.37
KROGER CO	61,306	38.27	2,346,180.62
SYSCO CORP	43,568	76.14	3,317,267.52
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,310	47.41	3,001,527.10
WALMART INC	134,198	140.30	18,827,979.40
ALTRIA GROUP INC	161,290	47.40	7,645,146.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,339	60.32	2,915,808.48
BOSTON BEER COMPANY INC-A	744	973.58	724,343.52
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26,220	74.12	1,943,426.40
BUNGE LIMITED	11,604	77.45	898,729.80
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.64	724,261.16
COCA-COLA CO	355,696	54.46	19,371,204.16
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	19,221	61.39	1,179,977.19
CONAGRA BRANDS INC	41,157	36.12	1,486,590.84
CONSTELLATION BRANDS INC-A	14,911	227.69	3,395,085.59
GENERAL MILLS INC	53,282	59.70	3,180,935.40
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,532	176.75	2,215,031.00
HORMEL FOODS CORP	27,157	47.44	1,288,328.08
JM SMUCKER CO	9,145	130.85	1,196,623.25
KELLOGG CO	21,630	64.28	1,390,376.40
KEURIG DR PEPPER INC	59,596	35.00	2,085,860.00
KRAFT HEINZ CO/THE	57,338	39.95	2,290,653.10
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,924	80.82	1,044,517.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,088	87.10	1,836,764.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	18,203	53.18	968,035.54
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	121,364	63.02	7,648,359.28
MONSTER BEVERAGE CORP	34,258	90.24	3,091,441.92
PEPSICO INC	118,953	149.48	17,781,094.44
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	135,448	99.40	13,463,531.20
TYSON FOODS INC	25,074	73.55	1,844,192.70
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,055	86.98	1,831,363.90
CLOROX COMPANY	10,830	180.88	1,958,930.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	70,441	82.43	5,806,451.63
ESTEE LAUDER CO-CL A	20,159	317.87	6,407,941.33



KIMBERLY-CLARK CORP	28,913	135.02	3,903,833.26
PROCTER & GAMBLE CO	212,538	137.03	29,124,082.14
ABBOTT LABORATORIES	152,754	119.74	18,290,763.96
ABIOMED INC	3,781	324.77	1,227,955.37
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,653	627.19	4,172,695.07
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,896	115.13	1,484,716.48
ANTHEM INC	21,058	388.61	8,183,349.38
BAXTER INTERNATIONAL	44,024	80.43	3,540,850.32
BECTON DICKINSON & CO	25,112	249.80	6,272,977.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	123,665	43.59	5,390,557.35
CARDINAL HEALTH	24,692	57.18	1,411,888.56
CENTENE CORP	51,303	73.51	3,771,283.53
CERNER CORP	27,382	79.57	2,178,785.74
CIGNA CORP	30,245	234.90	7,104,550.50
CVS HEALTH CORP	113,622	81.32	9,239,741.04
DANAHER CORP	55,620	277.47	15,432,881.40
DAVITA INC	5,784	122.09	706,168.56
DENTSPLY SIRONA INC	20,188	62.42	1,260,134.96
DEXCOM INC	8,405	440.73	3,704,335.65
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	53,513	107.51	5,753,182.63
HCA HEALTHCARE INC	23,291	218.79	5,095,837.89
HENRY SCHEIN INC	11,747	76.81	902,287.07
HOLOGIC INC	21,687	69.31	1,503,125.97
HUMANA INC	11,040	455.65	5,030,376.00
IDEXX LABORATORIES INC	7,438	667.03	4,961,369.14
INSULET CORP	5,923	280.69	1,662,526.87
INTUITIVE SURGICAL INC	10,199	950.78	9,697,005.22
LABORATORY CRP OF AMER	8,285	281.03	2,328,333.55
MASIMO CORP	4,835	260.33	1,258,695.55
MCKESSON CORP	13,893	189.10	2,627,166.30
MEDTRONIC PLC	117,112	128.17	15,010,245.04
MOLINA HEALTHCARE INC	4,940	257.25	1,270,815.00
NOVOCURE LTD	7,933	194.55	1,543,365.15
OAK STREET HEALTH INC	7,613	59.57	453,506.41
QUEST DIAGNOSTICS	11,335	135.04	1,530,678.40
RESMED INC	12,370	247.68	3,063,801.60
STERIS PLC	7,163	211.24	1,513,112.12
STRYKER CORP	29,094	264.43	7,693,326.42
TELADOC HEALTH INC	11,375	158.60	1,804,075.00
TELEFLEX INC	3,934	422.82	1,663,373.88
THE COOPER COS INC	4,134	411.23	1,700,024.82
UNITEDHEALTH GROUP INC	81,910	412.11	33,755,930.10

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7,248	153.95	1,115,829.60
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,775	321.41	3,784,602.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,317	374.19	2,363,758.23
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,277	159.31	2,911,708.87
10X GENOMICS INC-CLASS A	5,655	190.41	1,076,768.55
ABBVIE INC	152,263	116.58	17,750,820.54
AGILENT TECHNOLOGIES	26,029	150.03	3,905,130.87
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,936	184.20	3,488,011.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,665	176.74	1,884,932.10
AMGEN	49,749	245.20	12,198,454.80
AVANTOR INC	47,985	36.08	1,731,298.80
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	675.17	1,251,090.01
BIO-TECHNE CORP	3,245	465.39	1,510,190.55
BIOGEN INC	13,488	358.16	4,830,862.08
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	17,171	83.62	1,435,839.02
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	193,007	67.16	12,962,350.12
CATALENT INC	15,232	113.25	1,725,024.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	384.89	1,618,077.56
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	34.64	1,249,153.04
EXACT SCIENCES CORP	14,756	119.70	1,766,293.20
GILEAD SCIENCES INC	107,975	68.22	7,366,054.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	95.28	1,707,989.28
ILLUMINA INC	12,501	476.80	5,960,476.80
INCYTE CORP	17,504	82.04	1,436,028.16
IQVIA HOLDINGS INC	16,726	251.16	4,200,902.16
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	183.99	914,614.29
JOHNSON & JOHNSON	226,967	169.75	38,527,648.25
LILLY (ELI) & CO	70,198	234.99	16,495,828.02
MERCK & CO	218,163	77.99	17,014,532.37
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2,051	1,435.41	2,944,025.91
MODERNA INC	27,089	232.81	6,306,590.09
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,474	99.03	839,180.22
NOVAVAX INC	5,754	188.59	1,085,146.86
PERKINELMER INC	9,372	153.96	1,442,913.12
PFIZER	484,175	39.61	19,178,171.75
PPD INC	11,027	45.85	505,587.95
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,176	580.40	5,325,750.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,534	41.77	648,855.18
SEAGEN INC	11,471	148.50	1,703,443.50
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,401	9.30	747,729.30
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,944	517.26	17,557,873.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,458	198.16	4,450,277.28

VIATRIS INC	103,541	14.31	1,481,671.71
WATERS CORP	5,228	369.40	1,931,223.20
ZOETIS INC	40,822	197.50	8,062,345.00
BANK OF AMERICA CORP	670,589	40.04	26,850,383.56
CITIGROUP	181,157	68.45	12,400,196.65
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,041	45.31	1,633,017.71
FIFTH THIRD BANCORP	61,361	38.08	2,336,626.88
FIRST REPUBLIC BANK/CA	14,827	194.49	2,883,703.23
HUNTINGTON BANCSHARES INC	127,582	14.27	1,820,595.14
JPMORGAN CHASE & CO	263,503	155.77	41,045,862.31
KEY CORP	83,212	20.17	1,678,386.04
M & T BANK CORP	11,721	142.33	1,668,249.93
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,707	189.67	6,962,216.69
REGIONS FINL CORP	81,824	19.87	1,625,842.88
SVB FINANCIAL GROUP	4,393	575.24	2,527,029.32
TRUIST FINANCIAL CORP	115,723	55.21	6,389,066.83
US BANCORP	122,617	56.97	6,985,490.49
WELLS FARGO & CO	356,388	43.91	15,648,997.08
ALLY FINANCIAL INC	31,445	51.28	1,612,499.60
AMERICAN EXPRESS	59,420	171.94	10,216,674.80
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,185	248.95	2,535,555.75
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,153	61.17	926,909.01
BANK NEW YORK CO	71,298	49.93	3,559,909.14
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	118,353	280.49	33,196,832.97
BLACKROCK INC	13,255	901.31	11,946,864.05
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,302	160.55	6,470,486.10
CARLYLE GROUP INC/THE	12,595	47.71	600,907.45
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	118.79	1,054,261.25
CME GROUP INC	31,096	209.62	6,518,343.52
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	26,121	122.40	3,197,210.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	32,815	29.65	972,964.75
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	343.20	1,080,393.60
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	32.15	838,150.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	139.75	603,161.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,769	371.76	11,066,923.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	48,552	118.97	5,776,231.44
INVESCO LTD	35,765	26.33	941,692.45
KKR & CO INC	43,643	59.10	2,579,301.30
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	460.77	1,477,689.39
MOODY'S CORP	14,787	375.59	5,553,849.33
MORGAN STANLEY	122,211	90.33	11,039,319.63
MSCI INC	7,235	560.23	4,053,264.05

NASDAQ INC	9,657	175.77	1,697,410.89
NORTHERN TRUST CORP	17,625	115.55	2,036,568.75
PRICE T ROWE GROUP INC	20,087	205.20	4,121,852.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,324	132.02	1,362,974.48
S&P GLOBAL INC	20,689	414.68	8,579,314.52
SCHWAB (CHARLES) CORP	124,071	70.55	8,753,209.05
SEI INVESTMENTS COMPANY	12,261	62.12	761,653.32
STATE STREET CORP	29,894	84.11	2,514,384.34
SYNCHRONY FINANCIAL	49,509	48.73	2,412,573.57
THE BLACKSTONE GROUP INC	58,748	99.73	5,858,938.04
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	87.06	788,850.66
VOYA FINANCIAL INC	10,050	62.33	626,416.50
AFLAC	58,037	53.35	3,096,273.95
ALLEGHANY CORP	1,276	673.67	859,602.92
ALLSTATE CORP	26,425	133.47	3,526,944.75
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	123.43	779,954.17
AMERICAN INT'L GROUP	75,227	46.87	3,525,889.49
AON PLC	19,359	236.31	4,574,725.29
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,031	38.50	1,310,193.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,359	140.50	2,298,439.50
ASSURANT INC	4,726	156.99	741,934.74
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	10,207	66.92	683,052.44
BROWN & BROWN INC	19,873	52.95	1,052,275.35
CHUBB LTD	38,652	162.73	6,289,839.96
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,791	118.87	1,520,466.17
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	188.22	407,684.52
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	247.86	814,963.68
FNF GROUP	24,961	44.20	1,103,276.20
GLOBE LIFE INC	8,106	94.46	765,692.76
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,371	61.58	1,870,246.18
LINCOLN NATIONAL CORP	16,364	62.01	1,014,731.64
LOEWS CORP	18,851	54.71	1,031,338.21
MARKEL CORP	1,156	1,238.29	1,431,463.24
MARSH & MCLENNAN COS	44,622	142.60	6,363,097.20
METLIFE INC	64,294	58.86	3,784,344.84
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,072	61.99	1,430,233.28
PROGRESSIVE CORP	50,582	99.63	5,039,484.66
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,851	100.58	3,505,313.58
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	6,652	112.82	750,478.64
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,864	151.04	734,658.56
TRAVELERS COS INC/THE	22,437	153.33	3,440,265.21
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,021	228.21	2,515,102.41

MR BERKLEY CORP	11,715	75.62	885,888.30
CBRE GROUP INC-A	30,111	85.83	2,584,427.13
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.74	467,838.00
WEYERHAEUSER CO	63,665	35.82	2,280,480.30
ACCENTURE PLC-CL A	55,165	312.62	17,245,682.30
ADOBE INC	41,289	604.50	24,959,200.50
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,673	117.90	1,612,046.70
ANSYS INC	7,474	353.76	2,644,002.24
AUTODESK INC	18,964	295.38	5,601,586.32
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,764	203.72	7,489,562.08
AVALARA INC	7,698	161.28	1,241,533.44
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	64.20	898,543.20
BLACK KNIGHT INC	14,413	80.94	1,166,588.22
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	168.70	1,643,475.40
CADENCE DESIGN SYSTEMS	24,740	138.50	3,426,490.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	12,296	99.22	1,220,009.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10,486	123.80	1,298,166.80
CITRIX SYSTEMS INC	10,444	116.17	1,213,279.48
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,762	108.97	1,935,525.14
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	46,007	69.14	3,180,923.98
COUPA SOFTWARE INC	6,059	266.64	1,615,571.76
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	15,694	264.44	4,150,121.36
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	139.61	432,791.00
DATADOG INC - CLASS A	15,807	108.12	1,709,052.84
DOCUSIGN INC	15,540	288.02	4,475,830.80
DROPBOX INC-CLASS A	28,845	31.05	895,637.25
DYNATRACE INC	17,890	61.81	1,105,780.90
EPAM SYSTEMS INC	4,753	527.82	2,508,728.46
FAIR ISAAC CORP	2,615	524.05	1,370,390.75
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	53,834	144.42	7,774,706.28
FISERV INC	51,693	108.94	5,631,435.42
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,154	253.03	1,810,176.62
FORTINET INC	12,295	256.81	3,157,478.95
GARTNER INC	7,500	256.87	1,926,525.00
GLOBAL PAYMENTS INC	25,292	190.37	4,814,838.04
GODADDY INC - CLASS A	15,914	87.43	1,391,361.02
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,923	111.66	884,682.18
HUBSPOT INC	4,000	602.90	2,411,600.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,449	141.52	10,960,582.48
INTUIT INC	23,568	503.93	11,876,622.24
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,291	167.38	1,052,987.58
MASTERCARD INC-CLASS A	76,521	372.94	28,537,741.74

MICROSOFT CORP	619,180	277.94	172,094,889.20
MONGODB INC	4,623	353.70	1,635,155.10
NORTONLIFELOCK INC	50,376	27.66	1,393,400.16
OKTA INC	10,230	251.84	2,576,323.20
ORACLE CORP	164,854	87.76	14,467,587.04
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	43,290	23.29	1,008,224.10
PALO ALTO NETWORKS INC	8,311	390.24	3,243,284.64
PAYCHEX INC	27,703	111.90	3,099,965.70
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	383.59	1,624,503.65
PAYPAL HOLDINGS INC	95,999	300.21	28,819,859.79
PTC INC	9,984	145.14	1,449,077.76
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,393	294.81	1,884,720.33
SALESFORCE.COM INC	79,266	245.06	19,424,925.96
SERVICENOW INC	16,939	566.37	9,593,741.43
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	41,035	44.47	1,824,826.45
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,960	269.49	528,200.40
SPLUNK INC	14,752	138.37	2,041,234.24
SQUARE INC - A	33,292	241.89	8,053,001.88
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	73.55	1,422,089.25
SYNOPSYS INC	13,492	280.75	3,787,879.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35,780	77.95	2,789,051.00
TWILIO INC - A	13,692	392.27	5,370,960.84
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,713	478.84	1,777,932.92
UNITY SOFTWARE INC	4,329	106.53	461,168.37
VERISIGN INC	8,760	233.03	2,041,342.80
VISA INC-CLASS A SHARES	146,419	238.47	34,916,538.93
VMWARE INC-CLASS A	7,867	159.48	1,254,629.16
WESTERN UNION CO	38,757	23.31	903,425.67
WIX.COM LTD	5,010	294.81	1,476,998.10
WORKDAY INC-CLASS A	15,505	239.94	3,720,269.70
ZENDESK INC	10,500	143.48	1,506,540.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,545	385.08	6,756,228.60
ZSCALER INC	6,234	227.79	1,420,042.86
AMPHENOL CORPORATION	51,451	70.31	3,617,519.81
APPLE INC	1,450,831	145.11	210,530,086.41
ARISTA NETWORKS INC	5,179	378.03	1,957,817.37
ARROW ELECTRONICS INC	6,100	113.38	691,618.00
CDW CORP/DE	11,982	177.98	2,132,556.36
CISCO SYSTEMS	364,089	53.74	19,566,142.86
COGNEX CORP	16,230	86.58	1,405,193.40
CORNING	64,989	41.03	2,666,498.67
DELL TECHNOLOGIES -C	21,530	100.25	2,158,382.50

F5 NETWORKS INC	5,350	190.86	1,021,101.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	109,149	14.58	1,591,392.42
HP INC	106,353	30.04	3,194,844.12
IPG PHOTONICS CORP	3,207	207.41	665,163.87
JUNIPER NETWORKS INC	31,304	27.62	864,616.48
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,004	155.81	2,493,583.24
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,918	224.52	3,349,389.36
NETAPP INC	20,586	82.57	1,699,786.02
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,940	87.96	1,578,002.40
TE CONNECTIVITY LTD	29,387	138.00	4,055,406.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	21,176	83.26	1,763,113.76
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	70.17	1,809,684.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,612	547.73	2,526,130.76
AT&T INC	614,997	28.45	17,496,664.65
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	26.49	411,018.84
LIBERTY GLOBAL PLC-C	33,680	26.44	890,499.20
LUMEN TECHNOLOGIES INC	86,131	13.51	1,163,629.81
T-MOBILE US INC	53,388	146.01	7,795,181.88
VERIZON COMMUNICATIONS	356,926	56.07	20,012,840.82
AES CORP	61,761	25.73	1,589,110.53
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	56.76	1,179,359.28
AMEREN CORPORATION	20,898	81.92	1,711,964.16
AMERICAN ELECTRIC POWER	44,128	85.39	3,768,089.92
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,464	162.28	2,509,497.92
ATMOS ENERGY CORP	11,419	98.53	1,125,114.07
CENTERPOINT ENERGY INC	48,162	25.47	1,226,686.14
CMS ENERGY CORP	26,742	60.31	1,612,810.02
CONSOLIDATED EDISON INC	28,745	73.30	2,107,008.50
DOMINION ENERGY INC	69,073	75.55	5,218,465.15
DTE ENERGY COMPANY	16,240	115.60	1,877,344.00
DUKE ENERGY CORP	66,012	100.66	6,644,767.92
EDISON INTL	32,117	58.28	1,871,778.76
ENERGY CORP	16,926	102.92	1,742,023.92
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,834	47.94	998,781.96
EVERGY INC	21,330	61.79	1,317,980.70
EVERSOURCE ENERGY	29,303	82.63	2,421,306.89
EXELON CORP	86,723	44.91	3,894,729.93
FIRSTENERGY CORP	45,787	37.53	1,718,386.11
NEXTERA ENERGY INC	170,459	74.99	12,782,720.41
NISOURCE INC	35,781	25.14	899,534.34
NRG ENERGY INC	23,078	41.97	968,583.66
PG&E CORP	135,327	10.37	1,403,340.99

	PINNACLE WEST CAPITAL	10,772	83.65	901,077.80	
	PPL CORPORATION	69,904	28.44	1,988,069.76	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	43,258	60.49	2,616,676.42	
	SEMPRA ENERGY	27,056	132.86	3,594,660.16	
	SOUTHERN CO	91,389	61.47	5,617,681.83	
	UGI CORP	18,019	46.54	838,604.26	
	VISTRA CORP	37,797	19.32	730,238.04	
	WEC ENERGY GROUP INC	26,821	91.84	2,463,240.64	
	XCEL ENERGY INC	46,423	67.67	3,141,444.41	
	ADVANCED MICRO DEVICES	104,401	90.90	9,490,050.90	
	ANALOG DEVICES	31,938	166.27	5,310,331.26	
	APPLIED MATERIALS	79,412	134.90	10,712,678.80	
	BROADCOM INC	35,233	480.18	16,918,181.94	
	ENPHASE ENERGY INC	11,000	183.80	2,021,800.00	
	INTEL CORP	350,418	55.99	19,619,903.82	
	KLA CORP	13,649	308.76	4,214,265.24	
	LAM RESEARCH CORP	12,499	612.85	7,660,012.15	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,440	57.00	4,015,080.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	22,641	100.03	2,264,779.23	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,404	144.02	3,226,624.08	
	MICRON TECHNOLOGY	96,673	78.74	7,612,032.02	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,953	382.60	1,512,417.80	
	NVIDIA CORP	53,433	802.01	42,853,800.33	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	24,180	200.35	4,844,463.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	35,996	37.75	1,358,849.00	
	QORVO INC	9,678	192.94	1,867,273.32	
	QUALCOMM	98,431	141.43	13,921,096.33	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,359	189.57	2,722,035.63	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	4,600	267.68	1,231,328.00	
	TERADYNE INC	14,398	125.70	1,809,828.60	
	TEXAS INSTRUMENTS	79,929	190.27	15,208,090.83	
	XILINX INC	20,982	135.59	2,844,949.38	
	アメリカドル 小計	27,570,759		3,343,499,419.84 (368,353,331,083)	
カナダドル	CAMECO CORP	26,880	22.79	612,595.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,786	44.51	4,575,004.86	
	CENOVUS ENERGY INC	96,666	11.37	1,099,092.42	
	ENBRIDGE	173,165	50.11	8,677,298.15	
	IMPERIAL OIL	24,763	36.45	902,611.35	
	INTER PIPELINE LTD	35,455	20.12	713,354.60	
	KEYERA CORP	18,607	33.08	615,519.56	
	PARKLAND CORP	14,075	39.68	558,496.00	



PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	39.91	1,822,530.06
SUNCOR ENERGY	132,181	28.97	3,829,283.57
TC ENERGY CORP	82,366	62.56	5,152,816.96
AGNICO EAGLE MINES	20,293	76.52	1,552,820.36
B2GOLD CORP	90,243	5.06	456,629.58
BARRICK GOLD CORP	153,589	26.32	4,042,462.48
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	68.64	901,860.96
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,000	28.85	1,586,750.00
FRANCO-NEVADA CORP	16,953	183.35	3,108,332.55
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	9.20	476,992.40
KINROSS GOLD CORP	108,451	7.86	852,424.86
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,428	49.03	1,148,674.84
LUNDIN MINING CORP	62,243	11.54	718,284.22
NUTRIEN LTD	48,966	76.22	3,732,188.52
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	35.44	652,485.84
TECK RESOURCES LTD-CL B	40,561	29.28	1,187,626.08
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,800	93.46	728,988.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	39,528	55.32	2,186,688.96
YAMANA GOLD INC	81,672	5.25	428,778.00
BALLARD POWER SYSTEMS INC	19,724	21.15	417,162.60
CAE INC	25,999	38.55	1,002,261.45
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,705	104.71	806,790.55
WSP GLOBAL INC	10,656	149.91	1,597,440.96
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	39.50	533,447.50
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	10,245	74.32	761,408.40
THOMSON REUTERS CORP	15,013	126.31	1,896,292.03
AIR CANADA	13,805	25.75	355,478.75
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,870	133.74	8,140,753.80
CP RAILWAY LIMITED	57,581	93.04	5,357,336.24
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,282	112.87	2,627,839.34
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	44.16	754,208.64
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	80.10	1,848,147.30
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.05	502,360.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	35,422	36.18	1,281,567.96
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,409	193.87	1,048,642.83
DOLLARAMA INC	26,700	57.18	1,526,706.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	74,153	46.34	3,436,250.02
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	39.86	607,984.58
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	78.57	1,014,574.41
METRO INC	18,840	60.52	1,140,196.80
WESTON (GEORGE) LTD	6,883	119.30	821,141.90
SAPUTO INC	24,489	37.00	906,093.00

	BAUSCH HEALTH COS INC	27,800	36.47	1,013,866.00	
	CANOPY GROWTH CORP	20,989	27.59	579,086.51	
	BANK MONTREAL	55,894	126.12	7,049,351.28	
	BANK NOVA SCOTIA	104,760	78.90	8,265,564.00	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	38,790	141.87	5,503,137.30	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	93.50	2,551,521.50	
	ROYAL BANK OF CANADA	122,804	126.37	15,518,741.48	
	TORONTO-DOMINION BANK	156,322	84.70	13,240,473.40	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	110,862	63.85	7,078,538.70	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	43.98	337,986.30	
	ONEX CORP	6,603	90.06	594,666.18	
	TMX GROUP LTD	4,685	129.31	605,817.35	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,133	548.49	1,169,929.17	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	36.78	874,922.64	
	IA FINANCIAL CORP INC	10,099	67.15	678,147.85	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,043	172.03	2,243,787.29	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	163,056	23.99	3,911,713.44	
	POWER CORP OF CANADA	51,551	38.99	2,009,973.49	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	50,702	63.29	3,208,929.58	
	FIRSTSERVICE CORP	3,690	222.08	819,475.20	
	BLACKBERRY LIMITED	39,400	14.69	578,786.00	
	CGI INC - CL A	18,428	114.49	2,109,821.72	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,661	1,919.74	3,188,688.14	
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	8,296	106.02	879,541.92	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	103.49	445,110.49	
	OPEN TEXT CORP	24,643	64.15	1,580,848.45	
	SHOPIFY INC - CLASS A	9,710	1,862.97	18,089,438.70	
	BCE INC	6,203	61.99	384,523.97	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,584	66.69	2,039,646.96	
	TELUS CORP	32,908	27.96	920,107.68	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	18.77	972,623.86	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.49	646,223.55	
	ATCO LTD -CLASS I	5,241	44.26	231,966.66	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	50.87	574,576.65	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.97	361,030.28	
	EMERA INC	23,704	57.09	1,353,261.36	
	FORTIS INC	42,633	55.61	2,370,821.13	
	HYDRO ONE LTD	32,299	30.47	984,150.53	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	42.87	765,400.98	
	カナダドル 小計	3,516,775		206,436,873.13 (18,257,277,059)	
ユーロ	ENI	218,529	10.08	2,202,772.32	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	49,194	8.97	441,663.73
NESTE OIL OYJ	37,233	52.28	1,946,541.24
OMV AG	12,549	47.04	590,304.96
REPSOL SA	127,332	9.84	1,253,965.53
TENARIS SA	40,648	9.00	365,913.29
TOTALENERGIES SE	217,070	37.45	8,129,271.50
VOPAK	6,360	38.13	242,506.80
AIR LIQUIDE	40,492	147.92	5,989,576.64
AKZO NOBEL	15,301	105.25	1,610,430.25
ARCELORMITTAL	61,651	26.29	1,620,804.79
ARKEMA	5,949	106.80	635,353.20
BASF SE	78,752	68.01	5,355,923.52
COVESTRO AG	17,254	56.14	968,639.56
CRH PLC	64,773	42.40	2,746,375.20
EVONIK INDUSTRIES AG	19,754	28.73	567,532.42
FUCHS PETROLUB SE -PREF	5,762	41.06	236,587.72
HEIDELBERGCEMENT AG	13,041	74.62	973,119.42
KONINKLIJKE DSM NV	14,947	158.15	2,363,868.05
LANXESS	7,293	58.42	426,057.06
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	23,039	46.39	1,068,779.21
SOLVAY SA	6,906	110.00	759,660.00
STORA ENSO OYJ R	54,792	16.11	882,699.12
SYMRISE AG	11,456	120.20	1,377,011.20
UMICORE	17,605	51.34	903,840.70
UPM KYMMENE OYJ	45,603	33.19	1,513,563.57
VOESTALPINE AG	7,152	35.58	254,468.16
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	19,693	22.12	435,609.16
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	19,693	1.25	24,616.25
AIRBUS SE	50,151	112.76	5,655,026.76
ALSTOM	24,388	37.83	922,598.04
BOUYGUES ORD	21,446	31.76	681,124.96
BRENTAG SE	12,514	81.86	1,024,396.04
CNH INDUSTRIAL NV	93,026	13.67	1,272,130.55
DASSAULT AVIATION SA	213	988.00	210,444.00
EIFFAGE	7,964	86.90	692,071.60
FERROVIAL SA	41,438	25.46	1,055,011.48
GEA GROUP AG	13,382	35.07	469,306.74
KINGSPAN GROUP PLC	14,482	84.86	1,228,942.52
KION GROUP AG	5,887	92.26	543,134.62
KNORR-BREMSE AG	6,822	96.16	656,003.52
KONE OYJ-B	29,051	69.76	2,026,597.76
LEGRAND SA	21,768	91.70	1,996,125.60

MTU AERO ENGINES AG	4,753	213.80	1,016,191.40
PRYSMIAN SPA	21,155	30.52	645,650.60
RATIONAL AG	483	798.60	385,723.80
SAFRAN SA	28,410	119.92	3,406,927.20
SAINT-GOBAIN	43,973	57.75	2,539,440.75
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,506	137.02	6,372,252.12
SIEMENS	66,090	132.84	8,779,395.60
SIEMENS ENERGY AG	36,181	25.88	936,364.28
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,435	26.93	604,174.55
THALES SA	9,665	89.82	868,110.30
VINCI S.A.	45,934	91.74	4,213,985.16
WARTSILA OYJ	41,917	12.78	535,908.84
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.85	673,210.05
RANDSTAD NV	11,218	65.16	730,964.88
TELEPERFORMANCE	4,734	348.00	1,647,432.00
WOLTERS KLUWER	22,949	86.60	1,987,383.40
ADP	2,382	111.05	264,521.10
AENA SME SA	6,542	138.65	907,048.30
ATLANTIA SPA	46,597	15.44	719,457.68
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,272	10.05	234,023.23
DEUTSCHE POST AG-REG	85,364	58.27	4,974,160.28
GETLINK	44,101	13.86	611,239.86
INPOST SA	12,480	17.69	220,846.08
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,684	87.68	2,515,013.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.00	374,325.00
CONTINENTAL AG	9,928	118.64	1,177,857.92
DAIMLER AG	73,367	72.89	5,347,720.63
FAURECIA	10,948	40.36	441,861.28
FERRARI NV	10,170	176.00	1,789,920.00
MICHELIN	13,839	137.10	1,897,326.90
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	14,028	92.90	1,303,201.20
RENAULT SA	17,362	33.50	581,627.00
STELLANTIS NV	170,174	16.48	2,805,488.56
VALEO SA	21,538	24.98	538,019.24
VOLKSWAGEN AG-PFD	16,304	212.35	3,462,154.40
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	281.20	699,063.20
ADIDAS AG	16,242	318.45	5,172,264.90
ESSILORLUXOTTICA	25,177	154.34	3,885,818.18
HERMES INTERNATIONAL	2,731	1,235.50	3,374,150.50
KERING	6,473	731.20	4,733,057.60
LVMH	24,043	662.40	15,926,083.20
MONCLER SPA	18,219	56.36	1,026,822.84

PUMA SE	9,220	102.90	948,738.00
SEB SA	2,282	148.70	339,333.40
ACCOR	14,436	31.41	453,434.76
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,518	150.80	2,189,314.40
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	49.03	397,535.24
SODEXO	8,135	76.12	619,236.20
BOLLORE	83,646	4.49	375,905.12
PUBLICIS GROUPE	17,077	53.16	907,813.32
SCOUT24 AG	7,492	70.82	530,583.44
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,071	59.78	422,704.38
VIVENDI	61,243	28.25	1,730,114.75
DELIVERY HERO SE	13,414	119.15	1,598,278.10
HELLOFRESH SE	13,805	82.34	1,136,703.70
INDITEX	95,060	29.73	2,826,133.80
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	74.89	1,166,187.08
PROSUS	43,038	77.36	3,329,419.68
ZALANDO SE	17,664	101.50	1,792,896.00
CARREFOUR	52,544	16.35	859,094.40
COLRUYT SA	5,424	46.90	254,385.60
JERONIMO MARTINS	24,901	16.63	414,228.13
KESKO OYJ-B SHS	25,583	32.17	823,005.11
KONINKLIJKE AHOLD NV	87,400	25.34	2,214,716.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,788	58.88	3,755,837.44
DANONE (GROUPE)	54,643	59.46	3,249,072.78
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	49,077	11.18	548,680.86
HEINEKEN HOLDING NV	10,701	84.30	902,094.30
HEINEKEN NV	22,407	99.14	2,221,429.98
JDE PEET'S BV	7,000	31.13	217,910.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	120.50	1,572,525.00
PERNOD-RICARD	18,224	180.85	3,295,810.40
REMY COINTREAU	2,382	178.40	424,948.80
BEIERSDORF AG	9,190	102.15	938,758.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	78.35	687,913.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	87.76	1,267,166.64
LOREAL	21,631	371.80	8,042,405.80
AMPLIFON SPA	11,650	38.07	443,515.50
BIOMERIEUX	4,175	93.82	391,698.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	166.25	570,237.50
DIASORIN SPA	2,070	160.65	332,545.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	17,472	69.00	1,205,568.00
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	44.51	1,499,497.39
KONINKLIJKE PHILIPS	77,215	39.06	3,016,017.90

ORPEA	4,336	106.65	462,434.40
SARTORIUS AG-VORZUG	2,224	465.00	1,034,160.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,546	53.22	1,306,338.12
ARGENX SE	4,178	261.90	1,094,218.20
BAYER	83,832	50.83	4,261,180.56
EUROFINS SCIENTIFIC	12,420	101.58	1,261,623.60
GRIFOLS SA	27,685	21.68	600,210.80
IPSEN	3,532	88.00	310,816.00
MERCK KGAA	10,555	169.50	1,789,072.50
ORION OYJ-CLASS B	9,854	37.21	366,667.34
QIAGEN N.V.	21,801	42.70	930,902.70
RECORDATI SPA	9,859	50.20	494,921.80
SANOFI	97,536	87.22	8,507,089.92
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,419	434.30	1,050,571.70
UCB (GROUPE)	11,875	90.30	1,072,312.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	39,921	10.05	401,206.05
BANCO BILBAO VIZCAYA	576,942	5.22	3,015,675.83
BANCO SANTANDER SA	1,470,387	3.12	4,601,576.11
BNP PARIBAS	97,090	50.93	4,944,793.70
CAIXABANK	380,168	2.55	971,329.24
COMMERZBANK AG	94,388	5.70	538,577.92
CREDIT AGRICOLE SA	107,463	11.79	1,267,418.62
ERSTE GROUP BANK AG	23,905	31.09	743,206.45
FINECOBANK SPA	53,120	14.95	794,144.00
ING GROEP NV-CVA	343,429	10.87	3,735,133.80
INTESA SANPAOLO	1,441,455	2.28	3,292,283.22
KBC GROEP NV	21,052	66.30	1,395,747.60
MEDIOBANCA	53,990	9.75	526,510.48
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	12,490	18.89	235,936.10
SOCIETE GENERALE	67,846	24.77	1,680,884.65
UNICREDIT SPA	189,030	9.74	1,842,097.35
AMUNDI SA	6,226	75.80	471,930.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	177,263	10.50	1,861,261.50
DEUTSCHE BOERSE	16,510	144.45	2,384,869.50
EURAZEO SA	3,357	73.80	247,746.60
EXOR NV	10,345	66.70	690,011.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,615	95.38	1,012,458.70
NATIXIS	89,751	4.00	359,093.75
SOFINA	1,238	367.60	455,088.80
WENDEL	2,023	109.70	221,923.10
AEGON	166,267	3.55	590,912.91
AGEAS	16,065	46.84	752,484.60

ALLIANZ SE-REG	35,536	212.10	7,537,185.60
ASSICURAZIONI GENERALI	97,567	16.88	1,647,418.79
AXA SA	166,887	21.81	3,640,639.90
CNP ASSURANCES	16,287	14.67	238,930.29
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	5,789	146.00	845,194.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,376	230.85	2,856,999.60
NN GROUP NV	22,611	40.62	918,458.82
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.99	506,154.82
SAMPO OYJ-A SHS	43,075	39.65	1,707,923.75
SCOR SE	13,354	25.59	341,728.86
AROUNDTOWN SA	94,068	6.66	626,869.15
DEUTSCHE WOHNEN SE	28,092	51.58	1,448,985.36
LEG IMMOBILIEN SE	6,992	130.80	914,553.60
VONOVIA SE	45,080	57.62	2,597,509.60
ADYEN NV	1,666	2,118.50	3,529,421.00
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	39,094	57.58	2,251,032.52
ATOS SE	9,750	52.74	514,215.00
BECHTLE AG	2,553	161.35	411,926.55
CAPGEMINI SA	13,914	167.05	2,324,333.70
DASSAULT SYSTEMES SA	57,125	42.62	2,434,953.12
EDENRED	22,756	48.61	1,106,169.16
NEMETSCHKE SE	5,455	67.00	365,485.00
NEXI SPA	41,348	18.54	766,591.92
SAP SE	90,249	124.72	11,255,855.28
TEAMVIEWER AG	14,174	28.12	398,572.88
WORLDLINE SA	20,332	80.83	1,643,435.56
NOKIA OYJ	450,608	4.65	2,097,354.93
CELLNEX TELECOM SA	41,435	54.56	2,260,693.60
DEUTSCHE TELEKOM	285,034	18.00	5,130,612.00
ELISA A	13,387	51.52	689,698.24
ILIAD SA	1,253	120.55	151,049.15
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.70	294,698.25
KPN (KON.)	282,927	2.68	759,376.06
ORANGE	171,535	9.48	1,627,009.47
PROXIMUS	13,141	16.54	217,417.84
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.39	333,688.85
TELECOM ITALIA RNC	470,147	0.42	201,646.04
TELEFONICA	456,377	3.76	1,717,803.02
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.43	239,877.45
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	33.94	322,871.22
E.ON SE	185,377	10.12	1,877,498.25
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	20.48	439,623.68

	ELECTRICITE DE FRANCE	39,521	11.37	449,551.37
	ELIA GROUP SA/NV	2,925	90.65	265,151.25
	ENAGAS	25,299	18.33	463,730.67
	ENDESA	25,972	21.25	551,905.00
	ENEL	692,930	7.92	5,490,777.32
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.63	1,046,590.90
	ENGIE	158,224	11.60	1,836,347.74
	FORTUM OYJ	41,901	23.06	966,237.06
	IBERDROLA SA	498,312	10.28	5,122,647.36
	IBERDROLA SA-RTS	498,312	0.25	127,069.56
	NATURGY ENERGY GROUP SA	23,310	22.07	514,451.70
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	39,632	15.75	624,204.00
	RWE STAMM	55,390	31.27	1,732,045.30
	SNAM SPA	189,497	4.89	927,019.32
	SUEZ	32,549	19.54	636,170.20
	TERNA SPA	130,230	6.42	836,337.06
	UNIPER SE	7,335	31.65	232,152.75
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,427	25.95	1,126,930.65
	VERBUND AG	6,430	80.45	517,293.50
	ASM INTERNATIONAL NV	4,217	278.70	1,175,277.90
	ASML HOLDING NV	36,125	583.10	21,064,487.50
	INFINEON TECHNOLOGIES	112,361	33.11	3,720,272.71
	STMICROELECTRONICS	55,076	32.11	1,768,765.74
	ユーロ 小計	16,893,642		410,523,651.75 (53,704,704,121)
イギリスポンド	BP PLC	1,757,685	3.10	5,464,642.66
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	354,259	14.68	5,201,939.15
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,099	14.33	4,587,018.67
	ANGLO AMERICAN PLC	108,946	29.91	3,258,574.86
	ANTOFAGASTA PLC	35,856	14.42	517,222.80
	BHP GROUP PLC	182,400	22.62	4,125,888.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	13,112	76.38	1,001,494.56
	EVRAZ PLC	43,000	6.15	264,536.00
	GLENCORE PLC	875,677	3.19	2,796,912.33
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	31.62	532,733.76
	MONDI PLC	36,710	19.79	726,490.90
	RIO TINTO PLC REG	96,096	61.06	5,867,621.76
	ASHTREAD GROUP PLC	37,034	55.32	2,048,720.88
	BAE SYSTEMS PLC	260,104	5.38	1,399,359.52
	BUNZL PLC	24,880	25.56	635,932.80
	DCC PLC	9,127	59.60	543,969.20
	FERGUSON PLC	19,417	103.50	2,009,659.50



MELROSE INDUSTRIES PLC	456,624	1.59	728,315.28
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	786,119	1.01	793,980.19
SMITHS GROUP PLC	37,146	16.21	602,136.66
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	140.10	772,511.40
EXPERIAN PLC	79,162	29.38	2,325,779.56
INTERTEK GROUP PLC	13,890	56.02	778,117.80
RELX PLC	166,847	20.08	3,350,287.76
RENTOKIL INITIAL PLC	140,480	5.07	712,514.56
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	96,469	7.05	680,878.20
BURBERRY GROUP PLC	29,776	20.63	614,278.88
PERSIMMON PLC	25,686	30.04	771,607.44
TAYLOR WIMPEY PLC	355,934	1.64	585,867.36
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,829	47.58	562,823.82
COMPASS GROUP PLC	155,632	15.25	2,373,388.00
ENTAIN PLC	49,630	18.70	928,081.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,041	48.23	773,657.43
WHITBREAD PLC	17,434	31.36	546,730.24
AUTO TRADER GROUP PLC	97,321	6.40	623,438.32
INFORMA PLC	141,175	5.07	716,886.65
PEARSON	66,305	8.21	544,629.27
WPP PLC	113,065	9.67	1,094,016.94
JD SPORTS FASHION PLC	41,365	9.57	395,863.05
KINGFISHER PLC	198,587	3.67	730,005.81
NEXT PLC	11,468	78.40	899,091.20
OCADO GROUP PLC	44,612	19.09	851,643.08
MORRISON SUPERMARKETS	209,367	2.64	554,613.18
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.84	421,568.07
TESCO PLC	666,000	2.37	1,583,082.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	33,490	21.85	731,756.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO	188,273	27.72	5,219,868.92
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.73	462,110.80
DIAGEO	200,801	34.34	6,895,506.34
IMPERIAL BRANDS PLC	80,986	15.84	1,283,223.17
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	60,534	64.32	3,893,546.88
UNILEVER PLC	227,095	42.95	9,753,730.25
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	15.70	1,077,284.47
ASTRAZENECA	113,182	86.48	9,787,979.36
GLAXOSMITHKLINE	430,042	14.35	6,171,962.78
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	26.23	431,588.42
BARCLAYS	1,516,252	1.73	2,628,574.46
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,754,485	4.14	7,265,322.38
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,190,268	0.46	2,891,474.18

	NATWEST GROUP PLC	369,149	2.02	747,157.57
	STANDARD CHARTERED PLC	212,446	4.54	964,717.28
	3I GROUP PLC	88,121	12.02	1,059,655.02
	ABRDN PLC	210,980	2.83	598,550.26
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	16.53	546,961.26
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27,592	78.72	2,172,042.24
	M&G PLC	229,107	2.27	521,905.74
	SCHRODERS PLC	11,794	35.94	423,876.36
	ST JAMES'S PLACE PLC	50,535	15.18	767,121.30
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	31.21	507,318.55
	AVIVA PIC	332,730	4.05	1,347,556.50
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	113,715	2.92	332,502.66
	LEGAL & GENERAL GROUP	514,539	2.65	1,367,644.66
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.89	351,600.89
	PRUDENTIAL	225,330	13.79	3,107,300.70
	AVEVA GROUP PLC	10,917	39.24	428,383.08
	SAGE GROUP PLC	95,210	6.93	660,566.98
	HALMA PLC	31,069	27.75	862,164.75
	BT GROUP PLC	769,485	1.87	1,443,169.11
	VODAFONE GROUP PLC	2,359,596	1.18	2,799,424.69
	NATIONAL GRID PLC	306,760	9.39	2,882,316.96
	SEVERN TRENT PLC	22,468	26.47	594,727.96
	SSE PLC	92,294	15.29	1,411,175.26
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	58,580	10.31	604,252.70
	イギリスボンド 小計	25,504,232		152,294,531.89 (23,317,815,777)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	18.69	325,168.62
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	937.00	537,838.00
	GIVAUDAN-REG	795	4,333.00	3,444,735.00
	HOLCIM LTD	45,387	53.64	2,434,558.68
	SIKA AG-BR	12,505	309.10	3,865,295.50
	ABB LTD	149,042	32.85	4,896,029.70
	GEBERIT AG-REG	2,964	710.40	2,105,625.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,112	272.00	574,464.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,768	280.70	1,057,677.60
	ADECCO GROUP AG-REG	14,573	62.58	911,978.34
	SGS SA	506	2,896.00	1,465,376.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	314.60	1,439,924.20
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	45,940	110.65	5,083,261.00
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	310.20	770,226.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	59.55	234,507.90
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	2,208.00	618,240.00

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	10	99,200.00	992,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,525.00	781,050.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	248,795	115.20	28,661,184.00	
	ALCON INC	42,603	64.42	2,744,485.26	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,677	330.20	1,544,345.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	854	1,545.00	1,319,430.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,536	666.80	4,358,204.80	
	NOVARTIS	191,990	84.94	16,307,630.60	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,799	381.40	1,067,538.60	
	ROCHE HOLDING GENUSS	60,854	353.10	21,487,547.40	
	VIFOR PHARMA AG	4,486	123.90	555,815.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,854	81.00	231,174.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	213,343	9.19	1,960,622.17	
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,897	57.60	1,088,467.20	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,941	1,420.00	2,756,220.00	
	UBS GROUP AG	315,017	13.67	4,307,857.47	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,362	144.30	629,436.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,849	453.30	1,291,451.70	
	SWISS RE LTD	24,674	84.20	2,077,550.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,740	365.10	4,651,374.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,458	94.60	705,526.80	
	TEMENOS AG - REG	6,511	147.15	958,093.65	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	114.95	1,688,155.70	
	SWISSCOM	2,187	535.80	1,171,794.60	
	スイスフラン 小計	1,498,047		133,101,862.89 (16,040,105,496)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	17,222	295.90	5,095,989.80	
	BOLIDEN AB	23,903	332.50	7,947,747.50	
	SCA SV CELLULOSA B	56,967	149.85	8,536,504.95	
	ALFA LAVAL AB	27,268	311.80	8,502,162.40	
	ASSA ABLOY AB-B	86,548	268.30	23,220,828.40	
	ATLAS COPCO A	58,390	543.00	31,705,770.00	
	ATLAS COPCO B	31,902	458.70	14,633,447.40	
	EPIROC AB-A	58,039	203.80	11,828,348.20	
	EPIROC AB-B	37,972	173.10	6,572,953.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	292.70	4,098,385.40	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	107,624	90.34	9,722,752.16	
	SANDVIK AB	96,684	223.50	21,608,874.00	
	SKANSKA B	32,007	234.90	7,518,444.30	
	SKF AB-B	35,405	220.60	7,810,343.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	217.80	2,943,349.20	
	VOLVO B	123,279	211.95	26,128,984.05	

	SECURITAS B	29,533	140.20	4,140,526.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	239.50	5,093,925.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	115.90	4,486,720.80	
	EVOLUTION AB	14,096	1,422.80	20,055,788.80	
	EMBRACER GROUP AB	18,755	222.90	4,180,489.50	
	HENNES & MAURITZ B	65,999	198.38	13,092,881.62	
	ICA GRUPPEN AB	9,493	401.20	3,808,591.60	
	SWEDISH MATCH AB	127,270	75.46	9,603,794.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	286.60	14,179,248.40	
	NORDEA BANK ABP	280,957	95.40	26,803,297.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	138,470	111.75	15,474,022.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	131,166	98.60	12,932,967.60	
	SWEDBANK AB-A	72,526	163.80	11,879,758.80	
	EQT AB	20,102	342.30	6,880,914.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,115	330.60	3,344,019.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	312.20	3,486,649.60	
	INVESTOR AB-B SHS	157,664	205.20	32,352,652.80	
	KINNEVIK AB - B	18,792	343.90	6,462,568.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	571.00	4,156,880.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	9,450	587.40	5,550,930.00	
	SINCH AB	33,150	141.25	4,682,437.50	
	ERICSSON (LM) B	253,862	112.14	28,468,084.68	
	HEXAGON AB-B SHS	169,708	131.20	22,265,689.60	
	TELE2 AB-B SHS	50,012	120.05	6,003,940.60	
	TELIA CO AB	230,643	38.41	8,860,150.84	
	スウェーデンクローナ 小計	2,790,392		476,121,815.70 (6,118,165,331)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	76,370	177.66	13,567,894.20	
	NORSK HYDRO	126,800	56.40	7,151,520.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,408	476.60	7,820,052.80	
	ADEVINTA ASA	19,117	173.05	3,308,196.85	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	9,274	399.60	3,705,890.40	
	SCHIBSTED ASA-CL A	7,082	448.00	3,172,736.00	
	MOWI ASA	40,968	223.80	9,168,638.40	
	ORKLA	69,804	89.68	6,260,022.72	
	DNB BANK ASA	85,517	186.95	15,987,403.15	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	201.60	3,744,518.40	
	TELENOR ASA	65,744	149.65	9,838,589.60	
	ノルウェークローネ 小計	535,658		83,725,462.52 (1,062,476,119)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	10,347	561.80	5,812,944.60	
	NOVOZYMES A/S	19,125	474.30	9,070,987.50	

	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	755	3,200.00	2,416,000.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	87,375	241.70	21,118,537.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	299	17,450.00	5,217,550.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	514	18,045.00	9,275,130.00	
	DSV PANALPINA A S	18,142	1,519.50	27,566,769.00	
	PANDORA A/S	9,401	857.80	8,064,177.80	
	CARLSBERG AS-B	8,646	1,158.50	10,016,391.00	
	AMBU A/S-B	13,555	224.50	3,043,097.50	
	COLOPLAST-B	9,208	1,049.50	9,663,796.00	
	DEMANT A/S	11,604	337.10	3,911,708.40	
	GN STORE NORD A/S	11,967	551.40	6,598,603.80	
	GENMAB A/S	5,192	2,689.00	13,961,288.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	147,877	544.60	80,533,814.20	
	DANSKE BANK A/S	64,813	113.60	7,362,756.80	
	TRYG A/S	29,772	157.90	4,700,998.80	
	ORSTED A/S	15,439	926.60	14,305,777.40	
	デンマーククローネ 小計	464,031		242,640,328.30 (4,268,043,374)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	29.09	600,097.61	
	OIL SEARCH LTD	186,117	3.89	723,995.13	
	SANTOS	156,437	7.12	1,113,831.44	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,813	33.60	430,516.80	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,404	23.44	1,744,029.76	
	BHP GROUP LTD	252,353	49.48	12,486,426.44	
	BLUESCOPE STEEL LTD	49,328	21.26	1,048,713.28	
	EVOLUTION MINING LTD	122,154	4.57	558,243.78	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,483	23.87	3,305,589.21	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	44.01	1,626,081.48	
	NEWCREST MINING LIMITED	74,098	25.71	1,905,059.58	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	10.10	1,026,442.80	
	ORICA LTD	38,288	13.27	508,081.76	
	RIO TINTO LTD	32,028	125.40	4,016,311.20	
	SOUTH32 LTD	341,133	2.93	999,519.69	
	REECE LTD	16,814	22.99	386,553.86	
	BRAMBLES LTD	137,883	11.39	1,570,487.37	
	AURIZON HOLDINGS LTD	191,491	3.75	718,091.25	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.72	401,200.00	
	TRANSURBAN GROUP	233,493	14.42	3,366,969.06	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	52,752	41.70	2,199,758.40		
CROWN RESORTS LTD	30,328	10.99	333,304.72		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,541	114.72	406,223.52		
TABCORP HOLDINGS LTD	182,013	4.78	870,022.14		

	REA GROUP LTD	5,276	165.08	870,962.08
	SEEK LTD	31,593	31.94	1,009,080.42
	WESFARMERS LTD	100,575	58.00	5,833,350.00
	COLES GROUP LTD	115,478	16.85	1,945,804.30
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.25	686,881.25
	WOOLWORTHS GROUP LTD	109,901	38.07	4,183,931.07
	TREASURY WINE ESTATES LTD	70,538	11.90	839,402.20
	COCHLEAR LIMITED	6,220	243.26	1,513,077.20
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,248	63.26	1,027,848.48
	SONIC HEALTHCARE LTD	40,076	38.03	1,524,090.28
	CSL LIMITED	38,878	275.47	10,709,722.66
	AUST AND NZ BANKING GROUP	239,681	27.85	6,675,115.85
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	152,346	98.59	15,019,792.14
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	278,638	26.08	7,266,879.04
	WESTPAC BANKING	318,928	25.37	8,091,203.36
	ASX LTD	18,195	75.54	1,374,450.30
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,813	154.19	4,596,866.47
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	10,912	51.21	558,803.52
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	229,407	4.87	1,117,212.09
	MEDIBANK PRIVATE LTD	269,860	3.24	874,346.40
	QBE INSURANCE GROUP	138,071	10.50	1,449,745.50
	SUNCORP GROUP LIMITED	119,354	11.27	1,345,119.58
	AFTERPAY LTD	19,934	117.51	2,342,444.34
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	16.00	710,016.00
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	30.63	422,724.63
	XERO LTD	11,340	134.28	1,522,735.20
	TELSTRA CORP	308,467	3.75	1,156,751.25
	AGL ENERGY LTD	64,235	8.14	522,872.90
	AUSNET SERVICES	187,145	1.75	328,439.47
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,595	4.55	753,457.25
	オーストラリアドル 小計	5,834,938		128,618,675.51 (10,594,320,301)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	117,871	7.46	879,317.66
	A2 MILK CO LTD	66,854	7.60	508,090.40
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,520	30.00	1,635,600.00
	RYMAN HEALTHCARE LTD	36,317	13.09	475,389.53
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	4.89	846,547.02
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.55	423,215.15
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.22	577,039.68
	ニュージーランドドル 小計	623,837		5,345,199.44 (411,526,904)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	229,496	57.65	13,230,444.40

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	117,500	131.30	15,427,750.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	172,000	30.95	5,323,400.00	
	MTR CORP	151,000	44.20	6,674,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	59.60	10,370,400.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	30.85	6,108,300.00	
	SJM HOLDINGS LTD	132,000	8.17	1,078,440.00	
	WYNN MACAU LTD	140,800	11.64	1,638,912.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	172,200	17.10	2,944,620.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	23.60	3,443,240.00	
	WH GROUP LTD	936,500	6.61	6,190,265.00	
	BANK EAST ASIA	109,160	13.72	1,497,675.20	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	25.40	7,150,100.00	
	HANG SENG BANK	59,400	152.50	9,058,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	104,100	490.00	51,009,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,045,200	94.55	98,823,660.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	207,496	52.90	10,976,538.40	
	ESR CAYMAN LTD	157,000	24.70	3,877,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	18.18	3,145,140.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	36.40	4,558,299.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	37.35	5,093,606.25	
	SINO LAND CO	315,400	12.48	3,936,192.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	118,500	113.50	13,449,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	51.50	2,085,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	22.35	2,150,070.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	157,000	43.75	6,868,750.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	67,500	45.25	3,054,375.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	77.25	10,621,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	12.24	11,073,001.68	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	137,500	47.30	6,503,750.00	
	香港ドル 小計	6,942,612		327,363,904.13 (4,642,020,160)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	137,300	5.24	719,452.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.94	580,756.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	5.02	543,826.64	
	GENTING SINGAPORE LTD	615,000	0.84	516,600.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	4.51	805,486.00	
	DBS GROUP	155,200	29.66	4,603,232.00	
	OCBC BANK	291,200	11.91	3,468,192.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	25.74	2,416,986.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	78,300	11.16	873,828.00	
	CAPITALAND LTD	223,500	3.76	840,360.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.99	299,172.00	

	UOL GROUP LIMITED	47,500	7.31	347,225.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	18.92	486,244.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	752,243	2.26	1,700,069.18	
	シンガポールドル 小計	2,896,975		18,201,428.82 (1,483,962,491)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	67,756	21.85	1,480,468.60	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	417.50	895,955.00	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	26.80	2,634,708.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	108,864	25.24	2,747,727.36	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	15.55	1,547,225.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	99.50	1,244,048.50	
	AZRIELI GROUP	4,323	240.20	1,038,384.60	
	NICE LTD	5,891	836.00	4,924,876.00	
	イスラエルシェケル 小計	399,293		16,513,393.06 (555,221,558)	
	合 計	95,471,191		508,808,969,774 (508,808,969,774)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	114,413	1,042,302.43	
		LENDLEASE GROUP	64,786	755,404.76	
		SYDNEY AIRPORT	124,551	965,270.25	
		オーストラリアドル 小計	303,750	2,762,977.44 (227,586,451)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220,500	1,730,925.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	375,000	3,945,000.00	
		香港ドル 小計	595,500	5,675,925.00 (80,484,616)	
		投資信託受益証券合計	899,250	308,071,067 (308,071,067)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,260	781,331.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,971	2,090,524.05	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	38,586	10,744,271.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125,327	1,116,663.57	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,025	2,655,480.75	
		BOSTON PROPERTIES	13,029	1,526,607.93	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,788	1,240,689.84	
		CROWN CASTLE INTL CORP	36,859	7,435,197.48	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,924	3,726,402.24	



	DUKE REALTY CORP	31,540	1,572,269.00
	EQUINIX INC	7,704	6,319,745.28
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16,564	1,300,936.56
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32,077	2,621,011.67
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,510	1,764,522.40
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,882,228.92
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	1,573,411.40
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	67,709	1,158,500.99
	INVITATION HOMES INC	51,458	2,053,174.20
	IRON MOUNTAIN INC	27,546	1,204,862.04
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	1,025,738.00
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,603	1,735,262.10
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20,987	780,506.53
	PROLOGIS INC	63,163	7,920,008.57
	PUBLIC STORAGE	13,912	4,336,092.16
	REALTY INCOME CORP	31,608	2,176,842.96
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	813,340.11
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,586	3,156,957.38
	SIMON PROPERTY GROUP	28,176	3,654,145.44
	SUN COMMUNITIES INC	9,065	1,639,586.55
	UDR INC	28,059	1,457,945.64
	VENTAS INC	31,565	1,850,971.60
	VEREIT INC	21,159	1,008,014.76
	VICI PROPERTIES INC	49,459	1,554,990.96
	VORNADO REALTY TRUST	15,390	715,942.80
	WELLTOWER INC	35,679	3,083,735.97
	WP CAREY INC	16,500	1,286,505.00
	アメリカドル 小計	1,058,468	90,964,417.95 (10,021,549,925)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,887	544,684.23
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	356,270.00
	カナダドル 小計	24,377	900,954.23 (79,680,392)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	384,555.00
	GECINA SA	4,459	592,378.15
	KLEPIERRE	17,225	381,706.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	788,620.65
	ユーロ 小計	37,101	2,147,259.80 (280,904,527)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	409,140.92
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,349	457,011.91
	SEGRO PLC	106,999	1,246,003.35

イギリスポンド 小計		252,762	2,112,156.18 (323,392,232)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	971,949.70
	GOODMAN GROUP	139,848	2,984,356.32
	GPT GROUP	167,884	812,558.56
	MIRVAC GROUP	392,919	1,151,252.67
	SCENTRE GROUP	486,663	1,318,856.73
	STOCKLAND	207,412	939,576.36
	VICINITY CENTERS	365,149	567,806.69
オーストラリアドル 小計		1,853,965	8,746,357.03 (720,437,428)
香港ドル	LINK REIT	170,500	12,642,575.00
香港ドル 小計		170,500	12,642,575.00 (179,271,713)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	284,138	855,255.38
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	426,560	912,838.40
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220,000	481,800.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	273,085	573,478.50
シンガポールドル 小計		1,203,783	2,823,372.28 (230,189,541)
投資証券合計		4,600,956	11,835,425,758 (11,835,425,758)
合計			12,143,496,825 (12,143,496,825)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 601銘柄	97.4%			70.7%
	投資証券 36銘柄			2.6%	1.9%
カナダドル	株式 89銘柄	99.6%			3.5%
	投資証券 2銘柄			0.4%	0.0%
ユーロ	株式 234銘柄	99.5%			10.3%
	投資証券 4銘柄			0.5%	0.1%
イギリスポンド	株式 83銘柄	98.6%			4.5%

	投資証券 3銘柄			1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデンクローナ	株式 41銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	91.8%			2.0%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 30銘柄	94.7%			0.9%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.6%			0.3%
	投資証券 4銘柄			13.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	134,550,430
コール・ローン	3,592,971,376
国債証券	304,053,521,125
派生商品評価勘定	27,629,899
未収入金	30,699,204
未収利息	1,698,989,686
前払費用	58,151,440
差入委託証拠金	471,893,246
流動資産合計	310,068,406,406
資産合計	310,068,406,406
負債の部	

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	19,835,838
前受金	26,585,246
未払金	29,137,423
未払解約金	49,264,669
未払利息	5,482
流動負債合計	124,828,658
<b>負債合計</b>	124,828,658
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	100,722,788,748
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	209,220,789,000
元本等合計	309,943,577,748
純資産合計	309,943,577,748
負債純資産合計	310,068,406,406

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2021年 7月12日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,722,788,748口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0772円 (1万口当たり純資産額) (30,772円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2021年 7月12日現在
期首	2020年 7月11日
期首元本額	96,491,687,491円
期中追加設定元本額	17,610,847,912円
期中一部解約元本額	13,379,746,655円
期末元本額	100,722,788,748円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,423,389,430円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	610,286,906円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,066,930,698円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,388,253円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	7,332,425,280円
世界経済インデックスファンド	9,853,732,322円
DCマイセレクション25	1,906,152,059円
DCマイセレクション50	1,606,575,780円
DCマイセレクション75	1,091,766,842円
DC外国債券インデックス・オープン	2,175,375,656円
DCマイセレクションS25	891,567,483円
DCマイセレクションS50	684,698,901円
DCマイセレクションS75	363,886,754円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	38,615,318円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	85,329,117円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	42,644,496円
DC世界経済インデックスファンド	11,360,195,746円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	674,428,066円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	3,958,991円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,388,520円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,233,869円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	32,048,627円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	65,820,388円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	106,184,045円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	88,474,208円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	94,847,807円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,572,386,113円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	479,351,456円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,896,249,373円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	345,283,694円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	61,692,978円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	498,829,966円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	190,310,335円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	230,132,357円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	801,684,522円

区分	2021年 7月12日現在
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,741,615,177円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	774,648,652円
外国債券ファンド・シリーズ1	628,379,698円
コア投資戦略ファンド（安定型）	911,972,296円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,419,366,371円
分散投資コア戦略ファンドA	1,164,439,715円
分散投資コア戦略ファンドS	2,447,192,293円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	475,380,191円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,712,455,883円
コア投資戦略ファンド（切替型）	950,325,514円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	229,042,787円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	101,090,206円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,250,887,185円
SMT インデックスバランス・オープン	194,848,396円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	20,880,259,904円
SMT 世界経済インデックス・オープン	183,472,103円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	202,716,747円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	325,343,765円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,460,450円
グローバル経済コア	766,071,712円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,281,967円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,241,837円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	271,449,363円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	30,730,194円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	4,671,165円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	3,599,664円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	1,892,494円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	1,784,854円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	510,300,812円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,569,126,292円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	337,289,328円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	340,159,039円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	191,339,468円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,993,642,041
合計	2,993,642,041



(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,689,091,536	-	3,715,676,782	26,585,246
	合計	3,689,091,536	-	3,715,676,782	26,585,246

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

- 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,589,875,952	-	3,571,084,767	18,791,185
	アメリカドル	1,642,705,873	-	1,635,966,585	6,739,288
	カナダドル	165,370,970	-	163,610,485	1,760,485
	ユーロ	1,519,819,558	-	1,509,696,266	10,123,292
	イギリスポンド	261,979,551	-	261,811,431	168,120
	合計	3,589,875,952	-	3,571,084,767	18,791,185

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 01/15/24	10,000,000.00	9,953,906.30	
		T 0.125% 02/15/24	4,710,000.00	4,687,369.91	
		T 0.125% 04/30/23	5,000,000.00	4,993,945.30	
		T 0.125% 05/15/23	7,500,000.00	7,490,771.47	
		T 0.125% 09/15/23	8,060,000.00	8,038,590.62	
		T 0.125% 10/15/23	8,000,000.00	7,975,000.00	
		T 0.125% 12/15/23	3,250,000.00	3,237,050.79	
		T 0.125% 12/31/22	6,400,000.00	6,398,000.00	
		T 0.25% 03/15/24	13,000,000.00	12,970,546.94	
		T 0.25% 04/15/23	10,150,000.00	10,162,291.04	
		T 0.25% 05/15/24	10,000,000.00	9,964,453.10	
		T 0.25% 06/15/23	8,000,000.00	8,006,562.48	
		T 0.25% 06/30/25	1,000,000.00	985,859.38	
		T 0.25% 07/31/25	10,000,000.00	9,848,046.90	
		T 0.25% 09/30/25	7,500,000.00	7,372,265.62	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,534,750.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,874,375.04	
		T 0.375% 04/15/24	7,000,000.00	7,003,281.25	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,940,312.48	
		T 0.375% 07/31/27	9,500,000.00	9,168,613.30	
		T 0.375% 09/30/27	8,000,000.00	7,696,562.48	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,958,984.39	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,941,406.24	
		T 0.5% 02/28/26	11,500,000.00	11,376,914.12	
		T 0.5% 03/15/23	7,770,000.00	7,813,099.25	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	7,206,180.48	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,868,911.71	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,410,312.50	
		T 0.5% 06/30/27	7,100,000.00	6,912,238.29	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,524,022.64	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	7,262,695.35	
		T 0.625% 05/15/30	14,100,000.00	13,299,164.13	
		T 0.625% 08/15/30	15,950,000.00	14,997,984.37	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,437,695.32			

T 0.625% 12/31/27	10,000,000.00	9,738,671.90	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	8,335,976.60	
T 0.75% 03/31/26	11,000,000.00	11,000,000.00	
T 0.75% 04/30/26	3,000,000.00	2,998,476.57	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	10,699,644.58	
T 1.125% 02/15/31	15,050,000.00	14,745,472.73	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	8,033,125.04	
T 1.125% 05/15/40	8,060,000.00	7,072,020.35	
T 1.125% 08/15/40	9,300,000.00	8,131,687.50	
T 1.25% 03/31/28	5,150,000.00	5,208,339.86	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	8,085,625.04	
T 1.25% 05/15/50	10,650,000.00	8,866,957.08	
T 1.25% 07/31/23	4,550,000.00	4,645,798.83	
T 1.375% 01/31/25	9,000,000.00	9,270,000.00	
T 1.375% 06/30/23	5,000,000.00	5,114,941.40	
T 1.375% 08/15/50	9,900,000.00	8,507,039.11	
T 1.375% 08/31/23	2,500,000.00	2,560,742.20	
T 1.375% 09/30/23	4,000,000.00	4,099,218.76	
T 1.375% 10/15/22	5,000,000.00	5,079,394.55	
T 1.375% 11/15/40	13,000,000.00	11,870,625.00	
T 1.5% 01/15/23	6,200,000.00	6,326,906.25	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	6,201,796.86	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	6,588,279.68	
T 1.5% 02/28/23	7,800,000.00	7,970,472.66	
T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,091,015.64	
T 1.5% 08/15/22	10,000,000.00	10,153,906.30	
T 1.5% 08/15/26	8,400,000.00	8,690,718.79	
T 1.5% 09/15/22	9,500,000.00	9,655,117.23	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,786,542.99	
T 1.625% 02/15/26	8,100,000.00	8,430,328.12	
T 1.625% 04/30/23	3,500,000.00	3,590,371.08	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,363,194.14	
T 1.625% 05/15/31	9,470,000.00	9,701,571.14	
T 1.625% 05/31/23	1,000,000.00	1,026,738.28	
T 1.625% 08/15/22	2,500,000.00	2,541,845.70	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,957,246.12	
T 1.625% 08/31/22	5,000,000.00	5,086,425.80	
T 1.625% 10/31/23	2,500,000.00	2,578,027.35	
T 1.625% 10/31/26	7,300,000.00	7,599,128.88	
T 1.625% 11/15/22	8,080,000.00	8,243,178.10	
T 1.625% 11/15/50	8,050,000.00	7,364,492.18	
T 1.625% 11/30/26	8,780,000.00	9,138,402.32	

T 1.625% 12/15/22	3,600,000.00	3,676,500.00	
T 1.75% 01/31/23	7,550,000.00	7,737,275.40	
T 1.75% 05/15/23	3,690,000.00	3,795,438.87	
T 1.75% 06/30/22	7,000,000.00	7,113,339.87	
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,496,281.25	
T 1.75% 07/15/22	8,320,000.00	8,459,587.46	
T 1.75% 09/30/22	5,150,000.00	5,252,899.42	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	3,121,406.25	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	7,856,179.72	
T 1.875% 02/15/51	9,900,000.00	9,620,015.61	
T 1.875% 07/31/22	9,000,000.00	9,169,453.17	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,468,354.28	
T 1.875% 08/31/22	4,000,000.00	4,080,703.12	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	6,269,765.64	
T 1.875% 09/30/22	2,660,000.00	2,717,096.47	
T 1.875% 10/31/22	7,450,000.00	7,620,389.62	
T 2.125% 02/29/24	5,100,000.00	5,340,855.45	
T 2.125% 03/31/24	7,400,000.00	7,755,835.95	
T 2.125% 05/15/25	2,400,000.00	2,540,812.51	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,834,562.50	
T 2.125% 06/30/22	6,000,000.00	6,118,828.14	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	5,049,750.00	
T 2.125% 09/30/24	8,000,000.00	8,428,750.00	
T 2.125% 11/30/23	2,680,000.00	2,797,564.06	
T 2.125% 12/31/22	5,320,000.00	5,474,612.50	
T 2.25% 01/31/24	4,000,000.00	4,197,656.24	
T 2.25% 02/15/27	8,950,000.00	9,616,355.51	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	8,025,585.97	
T 2.25% 04/30/24	7,000,000.00	7,368,593.75	
T 2.25% 08/15/27	8,550,000.00	9,196,593.75	
T 2.25% 08/15/46	7,290,000.00	7,664,182.06	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	5,798,203.12	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,668,894.54	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	10,747,898.43	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,697,343.77	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	8,234,507.81	
T 2.25% 12/31/23	4,500,000.00	4,716,035.14	
T 2.25% 12/31/24	8,400,000.00	8,906,296.89	
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,172,363.30	
T 2.375% 02/29/24	5,760,000.00	6,069,150.02	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,798,453.13	
T 2.375% 05/15/27	10,750,000.00	11,636,035.21	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	8,708,997.69	

T 2.375% 05/15/51	2,750,000.00	2,988,476.56	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	5,300,976.55	
T 2.375% 11/15/49	7,500,000.00	8,124,609.37	
T 2.5% 01/31/24	3,470,000.00	3,663,154.28	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	5,350,000.00	
T 2.5% 02/15/45	3,210,000.00	3,527,489.06	
T 2.5% 02/15/46	4,000,000.00	4,403,437.52	
T 2.5% 03/31/23	4,050,000.00	4,211,525.38	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	8,378,320.35	
T 2.5% 05/15/46	5,050,000.00	5,560,128.93	
T 2.5% 08/15/23	4,550,000.00	4,765,414.06	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	5,091,947.67	
T 2.625% 02/15/29	9,990,000.00	11,037,389.06	
T 2.625% 02/28/23	1,400,000.00	1,456,300.77	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,803,945.31	
T 2.625% 06/30/23	4,900,000.00	5,132,080.07	
T 2.625% 12/31/23	3,500,000.00	3,700,292.96	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	6,313,790.62	
T 2.75% 02/15/24	3,000,000.00	3,188,906.25	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	7,263,847.68	
T 2.75% 04/30/23	3,600,000.00	3,765,656.26	
T 2.75% 05/31/23	3,880,000.00	4,066,118.75	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,963,203.12	
T 2.75% 07/31/23	1,000,000.00	1,051,757.81	
T 2.75% 08/15/42	1,300,000.00	1,486,062.50	
T 2.75% 08/15/47	4,950,000.00	5,721,890.62	
T 2.75% 08/31/23	7,500,000.00	7,901,367.22	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	7,495,125.00	
T 2.75% 11/15/23	6,120,000.00	6,474,290.65	
T 2.75% 11/15/42	2,820,000.00	3,223,612.50	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	3,528,707.04	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	4,348,125.00	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	8,119,289.09	
T 2.875% 05/15/43	4,150,000.00	4,842,531.25	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	6,630,040.62	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	4,157,532.83	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,952,253.12	
T 2.875% 08/15/28	8,920,000.00	9,989,006.25	
T 2.875% 08/15/45	4,300,000.00	5,048,804.70	
T 2.875% 09/30/23	4,750,000.00	5,025,537.09	
T 2.875% 10/31/23	2,500,000.00	2,649,511.72	
T 2.875% 11/30/23	4,020,000.00	4,267,638.27	

T 2.875% 11/30/25	7,500,000.00	8,210,156.25
T 2% 02/15/23	5,000,000.00	5,146,093.75
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,902,167.22
T 2% 02/15/50	5,000,000.00	5,000,000.00
T 2% 04/30/24	6,230,000.00	6,515,217.18
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,463,992.58
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,760,390.62
T 2% 07/31/22	3,000,000.00	3,060,351.57
T 2% 08/15/25	6,890,000.00	7,271,910.56
T 2% 10/31/22	10,000,000.00	10,244,726.60
T 2% 11/15/26	10,220,000.00	10,834,796.87
T 2% 11/30/22	2,000,000.00	2,051,875.00
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	1,270,910.16
T 3.125% 02/15/43	3,500,000.00	4,242,109.37
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	7,349,493.75
T 3.125% 08/15/44	4,140,000.00	5,043,037.50
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	9,569,437.50
T 3.125% 11/15/41	1,750,000.00	2,115,449.22
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	3,807,885.17
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	6,875,507.83
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	975,674.22
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	3,145,500.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	2,611,562.50
T 3.75% 08/15/41	2,000,000.00	2,633,906.26
T 3.75% 11/15/43	4,500,000.00	5,990,273.46
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,930,992.18
T 3% 02/15/47	2,800,000.00	3,378,812.50
T 3% 02/15/48	4,450,000.00	5,389,367.18
T 3% 02/15/49	7,000,000.00	8,517,031.25
T 3% 05/15/42	1,620,000.00	1,924,003.12
T 3% 05/15/45	3,500,000.00	4,191,250.00
T 3% 05/15/47	5,710,000.00	6,897,055.49
T 3% 08/15/48	5,450,000.00	6,615,363.30
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,610,156.25
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	5,494,726.55
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	3,346,656.26
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	1,247,062.50
T 4.25% 11/15/40	2,350,000.00	3,283,574.23
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,392,812.50
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,688,054.69
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,774,332.04
T 4.375% 11/15/39	1,260,000.00	1,774,828.12
T 4.5% 02/15/36	1,590,000.00	2,205,752.35

	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	777,476.56
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	2,426,617.19
	T 4.625% 02/15/40	2,380,000.00	3,458,623.44
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	1,113,867.18
	T 5.0% 05/15/37	1,100,000.00	1,620,609.37
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,679,640.62
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,669,824.22
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,562,156.25
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	2,106,472.65
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,909,128.91
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,490,671.87
	T 6.25% 08/15/23	1,650,000.00	1,857,796.87
	アメリカドル 小計	1,200,330,000.00	1,254,878,264.13 (138,249,938,359)
カナダドル	CAN 0.25% 02/01/23	3,060,000.00	3,052,472.40
	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,208,864.00
	CAN 0.25% 04/01/24	2,400,000.00	2,373,600.00
	CAN 0.25% 05/01/23	2,600,000.00	2,589,106.00
	CAN 0.25% 08/01/22	910,000.00	909,572.30
	CAN 0.25% 11/01/22	1,770,000.00	1,767,327.30
	CAN 0.5% 09/01/25	3,990,000.00	3,930,668.70
	CAN 0.5% 12/01/30	2,420,000.00	2,244,477.40
	CAN 1.25% 03/01/25	2,400,000.00	2,440,080.00
	CAN 1.25% 06/01/30	5,620,000.00	5,608,029.40
	CAN 1.5% 06/01/23	1,070,000.00	1,090,511.90
	CAN 1.5% 06/01/26	1,360,000.00	1,396,162.40
	CAN 1.5% 06/01/31	1,400,000.00	1,416,380.00
	CAN 1.5% 09/01/24	600,000.00	614,790.00
	CAN 1.75% 03/01/23	3,620,000.00	3,697,974.80
	CAN 1% 06/01/27	1,730,000.00	1,725,761.50
	CAN 1% 09/01/22	2,500,000.00	2,519,600.00
	CAN 2.25% 03/01/24	2,300,000.00	2,398,049.00
	CAN 2.25% 06/01/25	1,800,000.00	1,900,908.00
	CAN 2.25% 06/01/29	1,260,000.00	1,361,455.20
	CAN 2.5% 06/01/24	300,000.00	315,750.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,880,000.00	2,268,069.60
	CAN 2.75% 12/01/64	560,000.00	707,358.40
	CAN 2% 06/01/28	1,310,000.00	1,386,438.50
	CAN 2% 09/01/23	4,310,000.00	4,443,954.80
	CAN 2% 12/01/51	4,710,000.00	4,911,964.80
	CAN 3.5% 12/01/45	1,480,000.00	1,985,938.00
	CAN 4.0% 06/01/41	1,050,000.00	1,458,450.00

	CAN 5.75% 06/01/29	1,170,000.00	1,571,017.50	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,410,000.00	2,063,450.40	
	CAN 5% 06/01/37	820,000.00	1,212,394.60	
	カナダドル 小計	64,090,000.00	67,570,576.90 (5,975,941,821)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	10,897,915.50	
	MBONO 10% 12/05/24	29,660,000.00	33,099,966.80	
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,980,000.00	44,754,173.20	
	MBONO 6.75% 03/09/23	29,950,000.00	30,454,058.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	38,910,000.00	40,626,320.10	
	MBONO 7.75% 05/29/31	24,180,000.00	25,746,622.20	
	MBONO 7.75% 11/13/42	24,190,000.00	25,158,809.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	14,100,000.00	15,080,373.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	39,970,000.00	44,366,700.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	26,220,000.00	29,241,592.80	
	MBONO 8% 09/05/24	34,470,000.00	36,255,890.70	
	MBONO 8% 11/07/47	24,630,000.00	26,292,771.30	
	MBONO 8% 12/07/23	34,870,000.00	36,461,466.80	
		メキシコペソ 小計	375,680,000.00	398,436,660.40 (2,208,056,284)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,370,000.00	1,398,441.20	
	BGB 0.2% 10/22/23	980,000.00	999,698.00	
	BGB 0.4% 06/22/40	710,000.00	695,132.60	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,620,000.00	1,681,430.40	
	BGB 0.65% 06/22/71	640,000.00	551,443.20	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,520,000.00	2,659,910.40	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,815,279.70	
	BGB 0.8% 06/22/28	2,090,000.00	2,257,367.20	
	BGB 0.9% 06/22/29	2,360,000.00	2,573,627.20	
	BGB 0% 10/22/27	430,000.00	440,745.70	
	BGB 0% 10/22/31	630,000.00	629,029.80	
	BGB 1.25% 04/22/33	1,500,000.00	1,709,430.00	
	BGB 1.45% 06/22/37	720,000.00	843,091.20	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,380,000.00	1,662,237.60	
	BGB 1.7% 06/22/50	1,140,000.00	1,405,677.00	
	BGB 1.9% 06/22/38	1,050,000.00	1,308,625.50	
	BGB 1% 06/22/26	2,280,000.00	2,452,755.60	
	BGB 1% 06/22/31	1,980,000.00	2,189,246.40	
	BGB 2.15% 06/22/66	870,000.00	1,250,250.90	
	BGB 2.25% 06/22/23	1,850,000.00	1,956,689.50	
BGB 2.25% 06/22/57	770,000.00	1,097,781.30		
BGB 2.6% 06/22/24	2,140,000.00	2,347,751.20		
BGB 3.75% 06/22/45	1,200,000.00	2,027,124.00		



BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,405,084.80
BGB 4.25% 03/28/41	2,400,000.00	4,087,224.00
BGB 4.25% 09/28/22	2,100,000.00	2,226,525.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,416,119.40
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,546,786.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,780,000.00	3,909,041.40
BGB 5% 03/28/35	2,690,000.00	4,454,155.80
BKO 0% 03/10/23	1,210,000.00	1,223,745.60
BKO 0% 12/15/22	4,950,000.00	4,998,955.50
BTPS 0.05% 01/15/23	2,030,000.00	2,044,595.70
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,668,424.80
BTPS 0.3% 08/15/23	1,850,000.00	1,874,882.50
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	590,028.20
BTPS 0.5% 02/01/26	3,710,000.00	3,790,544.10
BTPS 0.5% 07/15/28	620,000.00	623,844.00
BTPS 0.6% 06/15/23	1,110,000.00	1,131,123.30
BTPS 0.6% 08/01/31	1,850,000.00	1,821,269.50
BTPS 0.65% 10/15/23	2,170,000.00	2,218,152.30
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,332,620.00
BTPS 0.9% 04/01/31	3,800,000.00	3,865,512.00
BTPS 0.9% 08/01/22	3,180,000.00	3,225,187.80
BTPS 0.95% 03/01/23	2,000,000.00	2,044,180.00
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	980,750.40
BTPS 0.95% 03/15/23	2,580,000.00	2,638,127.40
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	2,290,299.20
BTPS 0.95% 09/15/27	2,380,000.00	2,477,818.00
BTPS 0.95% 12/01/31	1,700,000.00	1,725,007.00
BTPS 0% 01/15/24	1,000,000.00	1,006,620.00
BTPS 0% 04/15/24	2,000,000.00	2,012,240.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	2,065,576.50
BTPS 1.35% 04/01/30	1,940,000.00	2,064,742.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,450,000.00	1,509,044.00
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,436,436.00
BTPS 1.45% 09/15/22	1,990,000.00	2,034,138.20
BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,530,368.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,559,926.10
BTPS 1.6% 06/01/26	2,830,000.00	3,040,014.30
BTPS 1.65% 03/01/32	3,010,000.00	3,268,589.10
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,762,681.80
BTPS 1.7% 09/01/51	1,120,000.00	1,104,902.40
BTPS 1.75% 07/01/24	3,200,000.00	3,386,496.00
BTPS 1.8% 03/01/41	1,810,000.00	1,915,740.20
BTPS 1.85% 05/15/24	2,000,000.00	2,118,420.00

BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,905,254.00	
BTPS 1% 07/15/22	2,160,000.00	2,192,011.20	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	3,036,111.80	
BTPS 2.1% 07/15/26	3,200,000.00	3,521,280.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	730,000.00	728,131.20	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,544,662.40	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,840,000.00	2,114,380.80	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	3,091,308.00	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,810,000.00	2,105,174.80	
BTPS 2.45% 10/01/23	2,910,000.00	3,090,245.40	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,950,000.00	3,274,146.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	3,216,621.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	2,510,000.00	3,053,866.80	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,320,000.00	1,587,735.60	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,890,000.00	2,215,306.80	
BTPS 2.95% 09/01/38	2,050,000.00	2,563,648.00	
BTPS 2% 02/01/28	2,690,000.00	2,982,725.80	
BTPS 2% 12/01/25	2,090,000.00	2,274,672.40	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,813,964.80	
BTPS 3.25% 09/01/46	1,950,000.00	2,593,285.50	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,220,000.00	2,854,143.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	2,120,000.00	2,926,172.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	3,960,000.00	4,936,773.60	
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,417,632.00	
BTPS 3.85% 09/01/49	2,160,000.00	3,194,532.00	
BTPS 3% 08/01/29	3,360,000.00	4,019,702.40	
BTPS 4.5% 03/01/24	2,750,000.00	3,095,647.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,512,411.20	
BTPS 4.5% 05/01/23	3,580,000.00	3,897,689.20	
BTPS 4.75% 08/01/23	4,950,000.00	5,472,175.50	
BTPS 4.75% 09/01/28	3,630,000.00	4,737,295.20	
BTPS 4.75% 09/01/44	3,050,000.00	4,937,736.50	
BTPS 4% 02/01/37	3,550,000.00	4,936,594.50	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,300,000.00	5,237,397.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	3,560,000.00	4,929,994.80	
BTPS 5.5% 09/01/22	1,400,000.00	1,494,878.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	3,450,000.00	3,716,823.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,080,000.00	4,724,997.20	
BTPS 5% 03/01/25	3,660,000.00	4,345,261.80	
BTPS 5% 08/01/34	2,970,000.00	4,407,361.20	
BTPS 5% 09/01/40	3,190,000.00	5,117,876.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,600,000.00	4,995,180.00	

BTPS 6% 05/01/31	3,940,000.00	5,924,459.80
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,929,032.00
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	971,832.00
DBR 0.25% 02/15/27	3,890,000.00	4,080,493.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,890,000.00	4,112,741.40
DBR 0.25% 08/15/28	2,180,000.00	2,302,210.80
DBR 0.5% 02/15/25	3,000,000.00	3,132,510.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	3,164,070.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,390,000.00	2,559,451.00
DBR 0.5% 08/15/27	5,690,000.00	6,071,628.30
DBR 0% 02/15/30	3,570,000.00	3,701,625.90
DBR 0% 02/15/31	800,000.00	826,480.00
DBR 0% 05/15/35	2,820,000.00	2,860,185.00
DBR 0% 05/15/36	1,670,000.00	1,679,552.40
DBR 0% 08/15/26	4,350,000.00	4,492,767.00
DBR 0% 08/15/29	3,500,000.00	3,629,185.00
DBR 0% 08/15/30	6,450,000.00	6,677,620.50
DBR 0% 08/15/30	670,000.00	697,791.60
DBR 0% 08/15/50	4,420,000.00	4,166,645.60
DBR 0% 11/15/27	2,160,000.00	2,236,528.80
DBR 1.25% 08/15/48	3,580,000.00	4,609,751.20
DBR 1.5% 02/15/23	2,960,000.00	3,064,280.80
DBR 1.5% 05/15/23	3,020,000.00	3,143,820.00
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,436,353.90
DBR 1.5% 09/04/22	2,800,000.00	2,871,092.00
DBR 1.75% 02/15/24	1,650,000.00	1,757,332.50
DBR 1.75% 07/04/22	2,090,000.00	2,140,160.00
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	2,107,940.00
DBR 1% 08/15/25	2,720,000.00	2,911,297.60
DBR 2.5% 07/04/44	3,540,000.00	5,524,028.40
DBR 2.5% 08/15/46	3,980,000.00	6,335,762.00
DBR 2% 08/15/23	2,860,000.00	3,024,621.60
DBR 3.25% 07/04/42	2,580,000.00	4,339,714.80
DBR 4.0% 01/04/37	2,930,000.00	4,828,669.30
DBR 4.25% 07/04/39	2,720,000.00	4,854,710.40
DBR 4.75% 07/04/28	2,550,000.00	3,521,193.00
DBR 4.75% 07/04/34	3,390,000.00	5,636,790.30
DBR 4.75% 07/04/40	2,830,000.00	5,430,430.40
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	4,478,282.40
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	3,338,102.00
DBR 6.25% 01/04/24	3,230,000.00	3,794,959.30
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,984,062.50
DBR 6.5% 07/04/27	980,000.00	1,407,436.80

FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,855,032.00	
FRTR 0.5% 05/25/25	5,590,000.00	5,819,972.60	
FRTR 0.5% 05/25/26	5,090,000.00	5,336,610.50	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,350,000.00	5,645,320.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,150,000.00	2,140,239.00	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	792,089.10	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,230,000.00	1,197,528.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,870,000.00	7,369,105.50	
FRTR 0.75% 05/25/52	3,800,000.00	3,711,422.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	6,200,000.00	6,661,342.00	
FRTR 0% 02/25/23	2,050,000.00	2,071,607.00	
FRTR 0% 02/25/24	3,500,000.00	3,556,070.00	
FRTR 0% 02/25/26	5,210,000.00	5,328,840.10	
FRTR 0% 02/25/27	950,000.00	970,539.00	
FRTR 0% 03/25/23	5,290,000.00	5,348,190.00	
FRTR 0% 03/25/24	5,950,000.00	6,050,436.00	
FRTR 0% 03/25/25	6,690,000.00	6,829,687.20	
FRTR 0% 11/25/29	5,260,000.00	5,322,857.00	
FRTR 0% 11/25/30	6,040,000.00	6,065,307.60	
FRTR 0% 11/25/31	2,910,000.00	2,894,606.10	
FRTR 1.25% 05/25/34	5,110,000.00	5,783,191.40	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,830,000.00	5,474,466.90	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,890,000.00	6,774,089.00	
FRTR 1.5% 05/25/50	4,090,000.00	4,845,259.40	
FRTR 1.75% 05/25/23	5,380,000.00	5,622,207.60	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,630,000.00	2,107,981.20	
FRTR 1.75% 06/25/39	3,820,000.00	4,699,402.20	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,492,841.60	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	5,033,206.50	
FRTR 1% 11/25/25	5,280,000.00	5,636,558.40	
FRTR 2.25% 05/25/24	4,100,000.00	4,441,776.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	5,740,000.00	5,955,537.00	
FRTR 2.5% 05/25/30	6,380,000.00	7,873,749.40	
FRTR 2.75% 10/25/27	5,970,000.00	7,157,015.10	
FRTR 2% 05/25/48	3,560,000.00	4,665,914.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,350,000.00	5,300,303.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	6,350,000.00	7,580,058.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	5,020,000.00	5,588,213.80	
FRTR 4.5% 04/25/41	4,720,000.00	8,285,771.20	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,680,000.00	5,952,768.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,660,000.00	5,129,863.20	
FRTR 4% 04/25/60	2,180,000.00	4,399,915.80	

FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	5,410,737.20
FRTR 5.5% 04/25/29	5,170,000.00	7,504,720.30
FRTR 5.75% 10/25/32	4,340,000.00	7,137,650.80
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,439,961.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,164,530.00
IRISH 0.2% 05/15/27	930,000.00	960,327.30
IRISH 0.2% 10/18/30	1,030,000.00	1,049,734.80
IRISH 0.4% 05/15/35	760,000.00	769,386.00
IRISH 0.55% 04/22/41	490,000.00	488,588.80
IRISH 0.9% 05/15/28	1,070,000.00	1,155,268.30
IRISH 0% 10/18/22	530,000.00	534,123.40
IRISH 0% 10/18/31	730,000.00	723,276.70
IRISH 1.1% 05/15/29	1,200,000.00	1,317,972.00
IRISH 1.3% 05/15/33	670,000.00	759,150.20
IRISH 1.35% 03/18/31	860,000.00	973,399.60
IRISH 1.5% 05/15/50	780,000.00	924,183.00
IRISH 1.7% 05/15/37	820,000.00	984,770.80
IRISH 1% 05/15/26	1,420,000.00	1,520,649.60
IRISH 2.4% 05/15/30	1,210,000.00	1,476,526.70
IRISH 2% 02/18/45	1,150,000.00	1,497,656.50
IRISH 3.4% 03/18/24	970,000.00	1,074,081.00
IRISH 3.9% 03/20/23	1,010,000.00	1,087,285.20
IRISH 5.4% 03/13/25	1,510,000.00	1,841,656.40
NETHER 0.25% 07/15/25	2,310,000.00	2,393,714.40
NETHER 0.25% 07/15/29	1,710,000.00	1,792,011.60
NETHER 0.5% 01/15/40	1,440,000.00	1,542,556.80
NETHER 0.5% 07/15/26	2,320,000.00	2,448,412.00
NETHER 0.75% 07/15/27	2,110,000.00	2,272,406.70
NETHER 0.75% 07/15/28	1,620,000.00	1,756,663.20
NETHER 0% 01/15/24	2,060,000.00	2,097,244.80
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,893,507.20
NETHER 0% 01/15/38	700,000.00	687,526.00
NETHER 0% 01/15/52	980,000.00	899,679.20
NETHER 0% 07/15/30	1,920,000.00	1,965,696.00
NETHER 0% 07/15/31	1,500,000.00	1,526,715.00
NETHER 1.75% 07/15/23	1,940,000.00	2,036,825.40
NETHER 2.25% 07/15/22	1,220,000.00	1,256,526.80
NETHER 2.5% 01/15/33	2,020,000.00	2,639,635.00
NETHER 2.75% 01/15/47	2,360,000.00	3,872,170.00
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	2,153,558.10
NETHER 3.75% 01/15/23	2,330,000.00	2,488,812.80
NETHER 3.75% 01/15/42	2,060,000.00	3,580,712.60
NETHER 4% 01/15/37	2,180,000.00	3,531,970.60

NETHER 5.5% 01/15/28	1,730,000.00	2,415,374.10	
NETHER 7.5% 01/15/23	200,000.00	225,014.00	
OBL 0% 04/05/24	4,250,000.00	4,333,002.50	
OBL 0% 04/10/26	4,070,000.00	4,196,251.40	
OBL 0% 04/11/25	3,750,000.00	3,848,437.50	
OBL 0% 04/14/23	2,220,000.00	2,247,838.80	
OBL 0% 10/07/22	4,160,000.00	4,196,316.80	
OBL 0% 10/10/25	4,340,000.00	4,466,641.20	
OBL 0% 10/13/23	1,510,000.00	1,535,005.60	
OBL 0% 10/18/24	3,490,000.00	3,571,247.20	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,770,000.00	1,873,987.50	
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	940,427.40	
RAGB 0.75% 02/20/28	1,620,000.00	1,742,326.20	
RAGB 0.75% 03/20/51	790,000.00	832,596.80	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	2,219,214.40	
RAGB 0.85% 06/30/20	400,000.00	386,060.00	
RAGB 0% 02/20/30	1,450,000.00	1,472,533.00	
RAGB 0% 02/20/31	740,000.00	746,275.20	
RAGB 0% 04/20/25	930,000.00	950,934.30	
RAGB 0% 07/15/23	1,500,000.00	1,520,580.00	
RAGB 0% 07/15/24	1,350,000.00	1,376,203.50	
RAGB 0% 09/20/22	320,000.00	322,662.40	
RAGB 0% 10/20/40	420,000.00	390,196.80	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,430,000.00	1,541,068.10	
RAGB 1.5% 02/20/47	930,000.00	1,159,719.30	
RAGB 1.5% 11/02/86	330,000.00	448,839.60	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	1,065,863.70	
RAGB 1.75% 10/20/23	1,330,000.00	1,404,333.70	
RAGB 2.1% 09/20/17	780,000.00	1,345,507.80	
RAGB 2.4% 05/23/34	1,260,000.00	1,633,905.00	
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	1,336,017.80	
RAGB 3.4% 11/22/22	2,360,000.00	2,491,876.80	
RAGB 3.8% 01/26/62	470,000.00	998,721.80	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,820,000.00	2,936,060.40	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,310,000.00	1,646,735.50	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,663,115.60	
RFGB 0.125% 04/15/36	540,000.00	535,345.20	
RFGB 0.125% 04/15/52	490,000.00	441,793.80	
RFGB 0.125% 09/15/31	400,000.00	407,464.00	
RFGB 0.25% 09/15/40	400,000.00	396,588.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	651,775.00	
RFGB 0.5% 09/15/27	870,000.00	921,573.60	

RFGB 0.5% 09/15/28	1,030,000.00	1,094,169.00
RFGB 0.5% 09/15/29	760,000.00	808,001.60
RFGB 0.75% 04/15/31	620,000.00	673,747.80
RFGB 0.875% 09/15/25	690,000.00	732,918.00
RFGB 0% 09/15/23	540,000.00	548,132.40
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	428,925.00
RFGB 0% 09/15/30	630,000.00	639,147.60
RFGB 1.125% 04/15/34	710,000.00	805,750.60
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	611,157.40
RFGB 1.5% 04/15/23	650,000.00	675,194.00
RFGB 1.625% 09/15/22	930,000.00	955,128.60
RFGB 2.625% 07/04/42	590,000.00	872,090.80
RFGB 2.75% 07/04/28	420,000.00	514,365.60
RFGB 2% 04/15/24	730,000.00	784,954.40
RFGB 4% 07/04/25	830,000.00	985,268.10
SPGB 0.1% 04/30/31	2,180,000.00	2,127,265.80
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,338,364.80
SPGB 0.35% 07/30/23	3,590,000.00	3,652,932.70
SPGB 0.45% 10/31/22	3,060,000.00	3,101,677.20
SPGB 0.5% 04/30/30	2,900,000.00	2,970,093.00
SPGB 0.5% 10/31/31	430,000.00	433,487.30
SPGB 0.6% 10/31/29	3,400,000.00	3,523,352.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,000,000.00	2,111,320.00
SPGB 0.85% 07/30/37	960,000.00	955,420.80
SPGB 0% 01/31/25	2,350,000.00	2,384,239.50
SPGB 0% 01/31/26	1,410,000.00	1,428,428.70
SPGB 0% 01/31/28	1,930,000.00	1,933,589.80
SPGB 0% 04/30/23	2,380,000.00	2,402,372.00
SPGB 0% 05/31/24	1,260,000.00	1,275,724.80
SPGB 1.2% 10/31/40	1,910,000.00	1,962,372.20
SPGB 1.25% 10/31/30	3,050,000.00	3,320,718.00
SPGB 1.3% 10/31/26	3,450,000.00	3,734,038.50
SPGB 1.4% 04/30/28	2,490,000.00	2,730,459.30
SPGB 1.4% 07/30/28	3,300,000.00	3,625,446.00
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,973,257.00
SPGB 1.45% 10/31/27	3,040,000.00	3,337,160.00
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	596,732.40
SPGB 1.5% 04/30/27	2,650,000.00	2,909,223.00
SPGB 1.6% 04/30/25	3,050,000.00	3,285,033.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,750,000.00	3,168,852.50
SPGB 1.95% 04/30/26	2,810,000.00	3,113,985.80
SPGB 1.95% 07/30/30	2,940,000.00	3,390,466.80
SPGB 1% 10/31/50	2,430,000.00	2,242,015.20

	SPGB 2.15% 10/31/25	2,810,000.00	3,115,924.70
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,440,000.00	2,953,400.40
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,850,000.00	2,468,547.50
	SPGB 2.75% 10/31/24	3,600,000.00	3,983,724.00
	SPGB 2.9% 10/31/46	2,250,000.00	3,085,785.00
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,940,000.00	3,047,759.40
	SPGB 3.8% 04/30/24	2,520,000.00	2,823,458.40
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,530,000.00	3,807,346.40
	SPGB 4.4% 10/31/23	2,690,000.00	2,996,337.20
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	3,425,380.80
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,640,000.00	4,407,981.60
	SPGB 4.8% 01/31/24	2,400,000.00	2,726,184.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	2,550,000.00	4,314,268.50
	SPGB 5.15% 10/31/28	4,290,000.00	5,896,090.20
	SPGB 5.15% 10/31/44	2,100,000.00	3,838,128.00
	SPGB 5.4% 01/31/23	2,100,000.00	2,294,880.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,220,000.00	5,072,433.80
	SPGB 5.9% 07/30/26	3,480,000.00	4,572,024.00
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,522,783.50
	ユーロ 小計	799,230,000.00	936,692,830.50 (122,538,156,086)
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	2,820,000.00	2,798,680.80
	UKT 0.125% 01/31/23	4,510,000.00	4,512,886.40
	UKT 0.125% 01/31/24	2,970,000.00	2,966,762.70
	UKT 0.125% 01/31/28	2,260,000.00	2,208,359.00
	UKT 0.25% 07/31/31	2,110,000.00	2,006,441.20
	UKT 0.375% 10/22/30	2,420,000.00	2,352,409.40
	UKT 0.5% 07/22/22	3,150,000.00	3,164,175.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,340,000.00	1,082,639.60
	UKT 0.625% 06/07/25	1,700,000.00	1,727,506.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,950,000.00	2,805,922.00
	UKT 0.625% 10/22/50	2,360,000.00	2,040,786.40
	UKT 0.75% 07/22/23	2,910,000.00	2,950,274.40
	UKT 0.875% 01/31/46	1,260,000.00	1,176,008.40
	UKT 0.875% 10/22/29	1,700,000.00	1,738,573.00
	UKT 1.25% 07/22/27	2,990,000.00	3,141,772.40
	UKT 1.25% 07/31/51	180,000.00	183,061.80
	UKT 1.25% 10/22/41	2,800,000.00	2,854,096.00
	UKT 1.5% 07/22/26	2,000,000.00	2,118,980.00
	UKT 1.5% 07/22/47	2,550,000.00	2,736,201.00
	UKT 1.625% 10/22/28	2,200,000.00	2,378,706.00
UKT 1.625% 10/22/54	1,860,000.00	2,098,191.60	



	UKT 1.625% 10/22/71	1,040,000.00	1,290,525.60	
	UKT 1.75% 01/22/49	1,300,000.00	1,477,671.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	2,530,000.00	2,992,534.60	
	UKT 1.75% 09/07/22	3,120,000.00	3,180,559.20	
	UKT 1.75% 09/07/37	2,930,000.00	3,234,134.00	
	UKT 1% 04/22/24	1,600,000.00	1,638,496.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	2,500,000.00	2,616,975.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,920,000.00	2,872,185.60	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,620,000.00	1,751,738.40	
	UKT 2% 09/07/25	1,780,000.00	1,910,580.80	
	UKT 3.25% 01/22/44	2,810,000.00	3,976,150.00	
	UKT 3.5% 01/22/45	2,550,000.00	3,778,717.50	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,930,000.00	3,664,915.60	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,600,000.00	2,679,072.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	2,390,000.00	3,461,915.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	2,100,000.00	2,862,258.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,820,000.00	2,776,009.60	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,370,000.00	1,701,498.90	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,900,000.00	2,947,926.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,180,000.00	3,654,944.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	2,640,476.60	
	UKT 4.25% 12/07/55	2,210,000.00	4,163,816.80	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,770,000.00	2,561,172.30	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,340,000.00	3,839,776.20	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,780,000.00	2,443,904.40	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,650,000.00	2,626,602.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,540,000.00	2,937,550.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,800,000.00	2,114,712.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,250,000.00	1,747,187.50	
	イギリスbond 小計	105,880,000.00	128,586,438.10 (19,687,869,537)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,970,000.00	5,930,956.20	
	SGB 0.75% 05/12/28	9,380,000.00	9,858,849.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	7,430,000.00	7,817,251.60	
	SGB 1.5% 11/13/23	12,500,000.00	13,028,375.00	
	SGB 1% 11/12/26	9,010,000.00	9,553,032.70	
	SGB 2.25% 06/01/32	3,750,000.00	4,546,837.50	
	SGB 2.5% 05/12/25	10,050,000.00	11,113,591.50	
	SGB 3.5% 03/30/39	5,860,000.00	8,764,333.20	
	スウェーデンクローナ 小計	63,950,000.00	70,613,226.70 (907,379,963)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,000,000.00	2,999,130.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,040,000.00	5,108,392.80	

	NGB 1.5% 02/19/26	5,740,000.00	5,867,255.80	
	NGB 1.75% 02/17/27	6,060,000.00	6,286,280.40	
	NGB 1.75% 03/13/25	4,770,000.00	4,908,425.40	
	NGB 1.75% 09/06/29	7,640,000.00	7,978,375.60	
	NGB 2% 04/26/28	6,100,000.00	6,444,284.00	
	NGB 2% 05/24/23	11,260,000.00	11,542,288.20	
	NGB 3% 03/14/24	7,360,000.00	7,780,403.20	
ノルウェークローネ 小計		56,970,000.00	58,914,835.40 (747,629,261)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/22	8,020,000.00	8,109,342.80	
	DGB 0.25% 11/15/52	3,870,000.00	3,688,845.30	
	DGB 0.5% 11/15/27	10,420,000.00	10,967,779.40	
	DGB 0.5% 11/15/29	14,260,000.00	15,083,515.00	
	DGB 0% 11/15/31	3,110,000.00	3,115,660.20	
	DGB 1.5% 11/15/23	7,420,000.00	7,782,986.40	
	DGB 1.75% 11/15/25	7,280,000.00	7,994,896.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	15,750,000.00	28,050,907.50	
デンマーククローネ 小計		70,130,000.00	84,793,932.60 (1,491,525,274)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,900,000.00	1,793,353.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,542,912.00	
	POLGB 0% 04/25/23	1,230,000.00	1,221,943.50	
	POLGB 1.25% 10/25/30	2,600,000.00	2,505,672.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	4,116,792.90	
	POLGB 2.5% 01/25/23	5,860,000.00	6,060,998.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	6,050,000.00	6,363,934.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	6,060,000.00	6,421,176.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	3,780,000.00	4,016,968.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	6,030,000.00	6,537,123.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,520,000.00	7,107,452.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	6,260,000.00	6,807,311.80	
	POLGB 4% 10/25/23	3,760,000.00	4,066,214.40	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	783,318.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	3,410,000.00	3,642,152.80	
ポーランドズロチ 小計		61,550,000.00	64,987,322.10 (1,869,451,302)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,930,000.00	2,919,598.50	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,340,000.00	2,307,544.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	3,040,000.00	3,001,027.20	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,740,000.00	2,697,310.80	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,190,000.00	3,238,838.90	
	ACGB 1.75% 06/21/51	2,090,000.00	1,894,585.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,610,000.00	1,661,053.10	

	ACGB 1% 11/21/31	3,750,000.00	3,614,812.50	
	ACGB 1% 12/21/30	4,320,000.00	4,203,489.60	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,560,000.00	2,771,660.80	
	ACGB 2.25% 11/21/22	3,160,000.00	3,255,716.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	3,790,000.00	4,193,521.30	
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,380,000.00	1,481,609.40	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,630,000.00	1,828,061.30	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,230,000.00	1,402,778.10	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	2,148,823.40	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,858,370.00	
	ACGB 2.75% 11/21/29	3,150,000.00	3,542,710.50	
	ACGB 3.25% 04/21/25	3,480,000.00	3,844,182.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	3,200,000.00	3,709,248.00	
	ACGB 3.25% 06/21/39	980,000.00	1,180,733.40	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,620,000.00	2,064,349.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,680,000.00	1,964,457.60	
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,820,000.00	3,297,736.20	
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,910,000.00	2,543,508.80	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,835,388.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,500,000.00	2,741,475.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,350,000.00	3,543,630.00	
	オーストラリアドル 小計	70,360,000.00	75,746,219.80 (6,239,216,124)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	390,000.00	385,741.20	
	SIGB 1.75% 02/01/23	800,000.00	816,912.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	420,000.00	428,437.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	740,000.00	784,096.60	
	SIGB 2.25% 08/01/36	890,000.00	948,695.50	
	SIGB 2.375% 06/01/25	490,000.00	521,732.40	
	SIGB 2.375% 07/01/39	430,000.00	468,983.80	
	SIGB 2.625% 05/01/28	1,050,000.00	1,150,747.50	
	SIGB 2.75% 03/01/46	1,240,000.00	1,460,930.80	
	SIGB 2.75% 04/01/42	900,000.00	1,043,631.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	1,070,000.00	1,118,834.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	590,000.00	661,702.70	
	SIGB 2.875% 09/01/30	760,000.00	856,383.20	
	SIGB 2% 02/01/24	410,000.00	425,612.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,350,000.00	1,392,727.50	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	990,322.80	
	SIGB 3.5% 03/01/27	880,000.00	1,000,172.80	
	SIGB 3% 09/01/24	1,590,000.00	1,708,900.20	
	シンガポールドル 小計	14,830,000.00	16,164,565.40	

			(1,317,897,017)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,500,000.00	1,527,000.00
	MGS 3.478% 06/14/24	700,000.00	724,843.00
	MGS 3.48% 03/15/23	2,330,000.00	2,413,996.50
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,561,732.60
	MGS 3.733% 06/15/28	3,430,000.00	3,596,835.20
	MGS 3.757% 04/20/23	1,090,000.00	1,125,250.60
	MGS 3.757% 05/22/40	550,000.00	531,344.00
	MGS 3.795% 09/30/22	1,500,000.00	1,536,630.00
	MGS 3.8% 08/17/23	930,000.00	965,665.50
	MGS 3.844% 04/15/33	2,350,000.00	2,375,826.50
	MGS 3.882% 03/14/25	1,030,000.00	1,082,437.30
	MGS 3.885% 08/15/29	1,500,000.00	1,586,505.00
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,194,692.50
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,085,481.40
	MGS 3.9% 11/30/26	1,440,000.00	1,540,296.00
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	636,384.00
	MGS 3.955% 09/15/25	2,380,000.00	2,517,564.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,900,000.00	2,003,664.00
	MGS 4.065% 06/15/50	760,000.00	749,329.60
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,349,414.40
	MGS 4.232% 06/30/31	2,000,000.00	2,158,080.00
	MGS 4.254% 05/31/35	2,030,000.00	2,146,501.70
	MGS 4.392% 04/15/26	2,910,000.00	3,141,490.50
	MGS 4.498% 04/15/30	2,860,000.00	3,143,883.60
	MGS 4.642% 11/07/33	2,830,000.00	3,075,361.00
	MGS 4.736% 03/15/46	1,480,000.00	1,571,449.20
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,487,890.40
	MGS 4.893% 06/08/38	2,310,000.00	2,524,321.80
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,826,596.80	
MGS 4.935% 09/30/43	1,560,000.00	1,706,998.80	
マレーシアリンギット 小計		51,820,000.00	54,887,465.90 (1,445,016,826)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.15% 07/31/23	700,000.00	700,964.66
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,440,570.00
	ILGOV 0.75% 07/31/22	6,490,000.00	6,541,208.69
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,190,000.00	2,113,512.06
	ILGOV 1.5% 11/30/23	1,750,000.00	1,808,265.37
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,080,000.00	1,147,173.07
	ILGOV 1% 03/31/30	2,920,000.00	2,917,308.04
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,880,000.00	3,178,746.71
	ILGOV 3.75% 03/31/24	4,080,000.00	4,477,464.62
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3,130,000.00	4,094,095.71

	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,580,000.00	4,157,899.62	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	5,620,000.00	7,331,209.07	
	イスラエルシェケル 小計	35,840,000.00	40,908,417.62 (1,375,443,271)	
	合計		304,053,521,125 (304,053,521,125)	

## 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 216銘柄	100.0%	45.5%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 340銘柄	100.0%	40.3%
イギリスポンド	国債証券 50銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 30銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 12銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	760,211,286
コール・ローン	929,766,625
国債証券	69,702,775,676
未収利息	816,283,886
前払費用	82,543,739
流動資産合計	72,291,581,212
資産合計	72,291,581,212
負債の部	
流動負債	
未払金	272,103,080
未払解約金	22,428,929
未払利息	1,418
流動負債合計	294,533,427
負債合計	294,533,427
純資産の部	
元本等	
元本	40,865,028,836
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	31,132,018,949
元本等合計	71,997,047,785
純資産合計	71,997,047,785
負債純資産合計	72,291,581,212

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p>

	2021年 7月12日現在
	約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,865,028,836口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7618円 (1万口当たり純資産額) (17,618円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	35,367,224,488円
期中追加設定元本額	7,992,318,525円
期中一部解約元本額	2,494,514,177円
期末元本額	40,865,028,836円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国債券インデックス・オープン	4,467,278,189円
世界経済インデックスファンド	8,212,947,094円



区分	2021年 7月12日現在
D C新興国債券インデックス・オープン	4,943,087,552円
D C世界経済インデックスファンド	9,437,298,073円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,808,232,006円
コア投資戦略ファンド(安定型)	146,670,330円
コア投資戦略ファンド(成長型)	399,809,303円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	80,389,900円
分散投資コア戦略ファンドA	224,890,391円
分散投資コア戦略ファンドS	482,336,271円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	387,931,776円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,150,771,687円
コア投資戦略ファンド(切替型)	114,516,341円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	186,174,908円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	86,348,368円
S M T インデックスバランス・オープン	159,936,836円
外国債券S M T Bセレクション(SMA専用)	3,176,467,356円
S M T 世界経済インデックス・オープン	231,593,608円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	255,612,685円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	412,172,168円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,971,163円
グローバル経済コア	638,220,943円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	43,103,997円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	5,024,122円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	6,695,243円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	4,148,784円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	1,858,486円
D Cターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	1,562,890円
F O F s用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	77,033,105円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	245,807,993円
S M T A M海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	301,296,923円
S M T A M海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	301,183,796円
S M T A M海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	290,856,697円
S M T A M海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	289,032,886円
S M T A M海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	288,766,966円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,489,346,619
合計	2,489,346,619

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「新興国債券インデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	30,800,000.00	39,257,988.00		
		MBONO 10% 12/05/24	100,250,000.00	111,876,995.00		
		MBONO 5.75% 03/05/26	116,300,000.00	113,199,442.00		
		MBONO 6.5% 06/09/22	103,700,000.00	104,674,780.00		
		MBONO 6.75% 03/09/23	92,600,000.00	94,158,458.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	108,650,000.00	113,442,551.50		
		MBONO 7.75% 05/29/31	60,400,000.00	64,313,316.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	77,000,000.00	80,083,850.00		
		MBONO 7.75% 11/23/34	32,600,000.00	34,866,678.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	116,900,000.00	129,759,000.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	64,400,000.00	71,821,456.00		
		MBONO 8% 09/05/24	73,900,000.00	77,728,759.00		
		MBONO 8% 11/07/47	64,800,000.00	69,174,648.00		
		MBONO 8% 12/07/23	97,950,000.00	102,420,438.00		
		メキシコペソ 小計		1,140,250,000.00	1,206,778,359.50 (6,687,724,312)	
		ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/24	83,800,000.00	69,032,956.73	
			BLTN 0% 07/01/22	22,350,000.00	20,948,107.42	
			BLTN 0% 07/01/23	51,200,000.00	44,069,621.76	
			BLTN 0% 07/01/24	13,500,000.00	10,643,764.50	
			BNTNF 10% 01/01/23	39,550,000.00	40,886,227.04	
BNTNF 10% 01/01/25			31,800,000.00	33,313,131.95		
BNTNF 10% 01/01/27			31,400,000.00	32,979,852.25		
BNTNF 10% 01/01/29			17,400,000.00	18,307,164.06		
BNTNF 10% 01/01/31			7,450,000.00	7,766,690.30		

	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,457,750.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,935,625.00	
ブラジルレアル 小計		301,750,000.00	281,340,891.01	(5,892,459,889)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	375,000,000.00	326,239,726.12	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,535,000,000.00	2,458,469,391.88	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,690,000,000.00	1,742,056,630.60	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,480,000,000.00	1,502,235,480.04	
	BTPCL 4% 03/01/23	840,000,000.00	860,961,912.72	
	BTPCL 5% 03/01/35	1,890,000,000.00	1,900,717,853.58	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,480,000,000.00	1,647,079,835.88	
チリペソ 小計		10,290,000,000.00	10,437,760,830.82	(1,536,177,450)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	72,300,000,000.00	85,541,745,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	11,000,000,000.00	11,229,900,000.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	19,300,000,000.00	19,252,329,000.00	
コロンビアペソ 小計		102,600,000,000.00	116,023,974,000.00	(3,334,412,988)
ペルーヌエボソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	3,950,000.00	3,369,152.50	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	5,600,000.00	5,104,568.00	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,200,000.00	3,535,968.00	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	6,970,000.00	7,387,781.80	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	6,300,000.00	6,388,767.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	7,700,000.00	8,371,748.00	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	6,950,000.00	7,094,560.00	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	6,450,000.00	7,071,264.00	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	5,650,000.00	6,839,720.50	
ペルーヌエボソル 小計		52,770,000.00	55,163,529.80	(1,531,146,514)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	25,510,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	12,500,000.00	12,983,375.00	
ウルグアイペソ 小計		37,500,000.00	38,493,375.00	(96,706,906)
ドミニカペソ	DOMREP 8.9% 02/15/23	20,400,000.00	21,452,640.00	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	25,000,000.00	28,375,750.00	
ドミニカペソ 小計		45,400,000.00	49,828,390.00	(96,567,419)
トルコリラ	TURKGB 10.4% 03/20/24	3,950,000.00	3,362,951.00	
	TURKGB 10.5% 08/11/27	8,650,000.00	6,450,997.00	
	TURKGB 10.6% 02/11/26	9,950,000.00	7,783,188.50	
	TURKGB 10.7% 08/17/22	6,850,000.00	6,363,650.00	
	TURKGB 11.7% 11/13/30	12,400,000.00	9,408,500.00	
	TURKGB 11% 02/24/27	7,400,000.00	5,701,626.00	

	TURKGB 11% 03/02/22	7,350,000.00	7,044,019.50	
	TURKGB 12.2% 01/18/23	9,900,000.00	9,194,823.00	
	TURKGB 12.4% 03/08/28	4,700,000.00	3,832,615.00	
	TURKGB 12.6% 10/01/25	14,400,000.00	12,273,120.00	
	TURKGB 16.2% 06/14/23	7,100,000.00	6,919,731.00	
	TURKGB 7.1% 03/08/23	6,200,000.00	5,276,262.00	
	TURKGB 8.5% 09/14/22	5,100,000.00	4,607,136.00	
	TURKGB 8% 03/12/25	8,300,000.00	6,207,155.00	
	TURKGB 9% 07/24/24	10,750,000.00	8,670,412.50	
	トルコリラ 小計	123,000,000.00	103,096,186.50	(1,312,661,884)
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	31,100,000.00	27,123,865.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	53,700,000.00	49,770,771.00	
	CZGB 0.45% 10/25/23	47,000,000.00	46,118,750.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	46,900,000.00	43,857,597.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	46,000,000.00	43,754,280.00	
	CZGB 1% 06/26/26	59,200,000.00	57,464,848.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	42,900,000.00	44,295,537.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	51,000,000.00	53,703,510.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	50,300,000.00	54,192,717.00	
	CZGB 2% 10/13/33	52,200,000.00	53,272,188.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	28,000,000.00	36,608,600.00	
	CZGB 4.7% 09/12/22	35,800,000.00	37,619,714.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	37,700,000.00	42,366,506.00	
	チェココルナ 小計	581,800,000.00	590,148,883.00	(2,997,956,325)
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	458,500,000.00	447,454,735.00	
	HGB 1.5% 08/23/23	322,500,000.00	324,473,700.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	274,000,000.00	266,495,140.00	
	HGB 1.75% 10/26/22	275,000,000.00	278,668,500.00	
	HGB 1% 11/26/25	475,000,000.00	455,995,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	382,000,000.00	361,127,520.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	548,000,000.00	560,806,760.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	470,500,000.00	485,518,360.00	
	HGB 2% 05/23/29	173,000,000.00	168,680,190.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	587,000,000.00	623,775,550.00	
	HGB 3% 06/26/24	402,500,000.00	417,823,175.00	
	HGB 3% 08/21/30	555,000,000.00	580,824,150.00	
	HGB 3% 10/27/27	592,000,000.00	617,384,960.00	
	HGB 3% 10/27/38	340,000,000.00	333,567,200.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	749,456,400.00	
HGB 6.0% 11/24/23	471,000,000.00	520,831,800.00		

	HGB 6.75% 10/22/28	262,000,000.00	338,430,640.00	
	HGB 7% 06/24/22	280,000,000.00	296,494,800.00	
ハンガリーフォリント 小計		7,528,000,000.00	7,827,808,830.00 (2,879,099,398)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	10,500,000.00	9,910,635.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	12,850,000.00	12,788,320.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	14,100,000.00	13,588,452.00	
	POLGB 2.25% 04/25/22	12,000,000.00	12,217,440.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	13,800,000.00	14,455,914.00	
	POLGB 2.5% 01/25/23	19,900,000.00	20,582,570.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	14,250,000.00	14,989,432.50	
	POLGB 2.5% 07/25/26	24,100,000.00	25,536,360.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	14,400,000.00	15,302,736.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	14,200,000.00	15,394,220.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	21,550,000.00	23,491,655.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	13,250,000.00	14,408,447.50	
	POLGB 4% 10/25/23	10,850,000.00	11,733,624.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	10,850,000.00	11,588,668.00	
ポーランドズロチ 小計		206,600,000.00	215,988,474.00 (6,213,210,838)	
ロシアルーブル	RFLB 4.5% 07/16/25	195,500,000.00	179,420,125.00	
	RFLB 5.7% 05/17/28	219,000,000.00	204,088,290.00	
	RFLB 6.1% 07/18/35	192,000,000.00	175,067,520.00	
	RFLB 6.5% 02/28/24	149,000,000.00	147,784,160.00	
	RFLB 6.9% 05/23/29	158,000,000.00	157,492,820.00	
	RFLB 6% 10/06/27	217,500,000.00	207,442,800.00	
	RFLB 7.05% 01/19/28	146,000,000.00	146,671,600.00	
	RFLB 7.1% 10/16/24	165,100,000.00	166,318,438.00	
	RFLB 7.15% 11/12/25	210,400,000.00	212,529,248.00	
	RFLB 7.25% 05/10/34	160,500,000.00	162,478,965.00	
	RFLB 7.4% 07/17/24	202,200,000.00	205,220,868.00	
	RFLB 7.4% 12/07/22	165,100,000.00	167,254,555.00	
	RFLB 7.6% 07/20/22	117,700,000.00	119,157,126.00	
	RFLB 7.65% 04/10/30	221,500,000.00	230,519,480.00	
	RFLB 7.7% 03/16/39	133,500,000.00	140,700,990.00	
	RFLB 7.7% 03/23/33	158,000,000.00	165,201,640.00	
	RFLB 7.75% 09/16/26	141,500,000.00	146,521,835.00	
	RFLB 7.95% 10/07/26	181,000,000.00	189,009,250.00	
	RFLB 7% 01/25/23	71,200,000.00	71,642,152.00	
RFLB 7% 08/16/23	107,200,000.00	107,791,744.00		
RFLB 8.15% 02/03/27	156,000,000.00	164,667,360.00		
RFLB 8.5% 09/17/31	116,650,000.00	128,576,296.00		
		3,584,550,000.00	3,595,557,262.00	

ロシアルーブル 小計			(5,321,424,747)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	7,700,000.00	7,379,449.00
	MGS 3.478% 06/14/24	5,150,000.00	5,332,773.50
	MGS 3.48% 03/15/23	22,850,000.00	23,673,742.50
	MGS 3.502% 05/31/27	9,450,000.00	9,773,757.00
	MGS 3.733% 06/15/28	6,950,000.00	7,288,048.00
	MGS 3.757% 04/20/23	4,850,000.00	5,006,849.00
	MGS 3.757% 05/22/40	7,550,000.00	7,293,904.00
	MGS 3.8% 08/17/23	7,100,000.00	7,372,285.00
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,242,312.00
	MGS 3.885% 08/15/29	27,250,000.00	28,821,507.50
	MGS 3.899% 11/16/27	14,800,000.00	15,667,576.00
	MGS 3.9% 11/30/26	8,050,000.00	8,610,682.50
	MGS 3.906% 07/15/26	8,700,000.00	9,227,568.00
	MGS 3.955% 09/15/25	26,000,000.00	27,502,800.00
	MGS 4.059% 09/30/24	8,500,000.00	8,963,760.00
	MGS 4.065% 06/15/50	5,900,000.00	5,817,164.00
	MGS 4.181% 07/15/24	7,600,000.00	8,012,148.00
	MGS 4.254% 05/31/35	9,600,000.00	10,150,944.00
	MGS 4.762% 04/07/37	5,850,000.00	6,383,403.00
マレーシアリンギット 小計		202,050,000.00	210,520,673.00 (5,542,356,706)
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	90,500,000.00	91,043,905.00
	THAIGB 0.95% 06/17/25	116,700,000.00	118,029,213.00
	THAIGB 1.45% 12/17/24	99,000,000.00	101,858,130.00
	THAIGB 1.585% 12/17/35	56,800,000.00	53,205,696.00
	THAIGB 1.6% 06/17/35	44,100,000.00	41,598,648.00
	THAIGB 1.6% 12/17/29	85,100,000.00	85,810,585.00
	THAIGB 1.875% 06/17/22	59,300,000.00	60,083,353.00
	THAIGB 2.125% 12/17/26	106,100,000.00	113,130,186.00
	THAIGB 2.4% 12/17/23	91,000,000.00	95,117,750.00
	THAIGB 2.875% 12/17/28	83,200,000.00	92,523,392.00
	THAIGB 2% 06/17/42	61,600,000.00	57,377,936.00
	THAIGB 2% 12/17/22	53,500,000.00	54,662,555.00
	THAIGB 3.3% 06/17/38	178,700,000.00	203,081,828.00
	THAIGB 3.4% 06/17/36	119,200,000.00	136,927,424.00
	THAIGB 3.625% 06/16/23	84,000,000.00	89,024,040.00
	THAIGB 3.65% 06/20/31	97,300,000.00	114,698,213.00
	THAIGB 3.775% 06/25/32	89,400,000.00	106,984,086.00
	THAIGB 3.85% 12/12/25	97,400,000.00	110,605,492.00
	THAIGB 4.875% 06/22/29	105,500,000.00	132,089,165.00
タイバーツ 小計		1,718,400,000.00	1,857,851,597.00 (6,260,959,881)

フィリピン ペソ	PHILIP 3.9% 11/26/22	15,000,000.00	15,123,450.00	
	PHILIP 6.25% 01/14/36	20,000,000.00	23,891,200.00	
フィリピンペソ 小計		35,000,000.00	39,014,650.00 (85,843,934)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,307,938,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	16,200,000,000.00	19,530,234,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	33,500,000,000.00	33,684,250,000.00	
	INDOGB 5.625% 05/15/23	52,500,000,000.00	53,779,950,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	45,113,850,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,593,698,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	39,000,000,000.00	38,931,360,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	62,100,000,000.00	65,284,488,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	24,000,000,000.00	23,973,600,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	35,058,080,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	21,000,000,000.00	21,639,240,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	27,200,000,000.00	28,159,888,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	21,900,000,000.00	23,072,307,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/22	35,900,000,000.00	37,004,284,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	36,800,000,000.00	39,164,400,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	54,000,000,000.00	56,041,740,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	35,600,000,000.00	38,898,340,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,700,000,000.00	35,396,220,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	31,800,000,000.00	35,086,212,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	18,400,000,000.00	20,491,896,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	46,600,000,000.00	51,009,292,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	52,000,000,000.00	57,560,360,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	23,534,120,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	29,100,000,000.00	32,802,393,000.00	
INDOGB 8.75% 05/15/31	34,700,000,000.00	40,165,597,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,714,770,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	19,700,000,000.00	22,883,717,000.00		
インドネシアルピア 小計		860,400,000,000.00	918,882,224,000.00 (6,983,504,902)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	121,100,000.00	137,530,848.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	43,600,000.00	30,973,004.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	34,100,000.00	22,883,146.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	44,900,000.00	46,671,305.00	
	SAGB 7% 02/28/31	40,200,000.00	34,545,468.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	67,700,000.00	61,889,309.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	68,700,000.00	59,071,695.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	68,200,000.00	57,701,974.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	97,100,000.00	82,094,166.00	

	SAGB 8.875% 02/28/35	61,700,000.00	56,102,576.00	
	SAGB 8% 01/31/30	95,200,000.00	90,438,096.00	
	SAGB 9% 01/31/40	48,450,000.00	42,626,310.00	
	南アフリカランド 小計	790,950,000.00	722,527,897.00 (5,577,915,364)	
香港・オフ ショア人民 元	CGB 1.99% 04/09/25	20,000,000.00	19,406,000.00	
	CGB 2.36% 07/02/23	18,000,000.00	17,917,740.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	26,470,080.00	
	CGB 2.84% 04/08/24	4,700,000.00	4,721,009.00	
	CGB 2.85% 06/04/27	30,500,000.00	30,330,420.00	
	CGB 2.88% 11/05/23	16,900,000.00	16,989,570.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	34,000,000.00	34,216,580.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	5,000,000.00	5,008,150.00	
	CGB 3.02% 05/27/31	5,000,000.00	5,015,700.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	28,000,000.00	28,202,440.00	
	CGB 3.03% 03/11/26	8,000,000.00	8,068,320.00	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,207,200.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	20,700,000.00	20,798,532.00	
	CGB 3.19% 04/11/24	29,400,000.00	29,816,598.00	
	CGB 3.22% 12/06/25	12,000,000.00	12,211,200.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,400,400.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	14,900,000.00	15,167,455.00	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,460,680.00	
	CGB 3.28% 12/03/27	20,000,000.00	20,409,200.00	
	CGB 3.29% 05/23/29	26,000,000.00	26,509,340.00	
CGB 3.29% 10/18/23	16,000,000.00	16,254,080.00		
CGB 3.72% 04/12/51	5,100,000.00	5,249,634.00		
CGB 3.81% 09/14/50	23,700,000.00	24,675,729.00		
	香港・オフショア人民元 小計	429,200,000.00	432,506,057.00 (7,352,646,219)	
	合計		69,702,775,676 (69,702,775,676)	

## 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	9.6%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.5%



チリペソ	国債証券	7銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	4.8%
ペルーヌエボソル	国債証券	9銘柄	100.0%	2.2%
ウルグアイペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.1%
トルコリラ	国債証券	15銘柄	100.0%	1.9%
チェココルナ	国債証券	13銘柄	100.0%	4.3%
ハンガリーフォリント	国債証券	18銘柄	100.0%	4.1%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	8.9%
ロシアルーブル	国債証券	22銘柄	100.0%	7.6%
マレーシアリンギット	国債証券	19銘柄	100.0%	8.0%
タイバーツ	国債証券	19銘柄	100.0%	9.0%
フィリピンペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券	27銘柄	100.0%	10.0%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	8.0%
香港・オフショア人民元	国債証券	23銘柄	100.0%	10.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	3,283,917,299
投資証券	108,677,185,200
派生商品評価勘定	164,872,800
未収入金	388,319,977
未収配当金	698,732,434
差入委託証拠金	221,238,000
流動資産合計	113,434,265,710
資産合計	113,434,265,710
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	164,872,800
未払解約金	233,269,396
未払利息	5,011

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	398,147,207
負債合計	398,147,207
純資産の部	
元本等	
元本	49,323,843,791
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	63,712,274,712
元本等合計	113,036,118,503
純資産合計	113,036,118,503
負債純資産合計	113,434,265,710

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	49,323,843,791口
2. 1口当たり純資産額	2.2917円

2021年 7月12日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額) (22,917円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2021年 7月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	67,089,596,986円
期中追加設定元本額	5,714,855,447円
期中一部解約元本額	23,480,608,642円
期末元本額	49,323,843,791円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,642,287,080円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,366,440円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,942,983,060円
J リートインデックス・オープン（S M A 専用）	23,336,027,727円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,308,419,559円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,930,352,237円
分散投資コア戦略ファンド A	410,633,592円

区分	2021年 7月12日現在
分散投資コア戦略ファンドS	823,636,982円
コア投資戦略ファンド（切替型）	810,853,753円
SMT インデックスバランス・オープン	27,209,188円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	271,547,410円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,362,280円
グローバル経済コア	260,522,228円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	9,761,833円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	409,005,482円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,199,142円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	496,637,523円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	10,004,860円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	893,261,362円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	378,268,198円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	307,503,855円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	22,791,488,383
合計	22,791,488,383

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「J-REITインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	3,807,313,200	-	3,972,186,000	164,872,800
	合計	3,807,313,200	-	3,972,186,000	164,872,800

## (注)1.時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,504	224,848,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	2,252	301,092,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人	2,420	409,948,000	
	東海道リート投資法人	248	28,569,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,172	2,201,368,000	
	森ヒルズリート投資法人	10,812	1,816,416,000	
	産業ファンド投資法人	13,010	2,807,558,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	8,743	3,383,541,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	6,273	1,510,538,400	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	4,612	2,370,568,000	
	G L P 投資法人	29,705	5,688,507,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,138	1,564,164,000	
	日本プロロジスリート投資法人	14,551	5,187,431,500	
	星野リゾート・リート投資法人	1,400	989,800,000	
	O n e リート投資法人	1,435	491,487,500	
	イオンリート投資法人	9,336	1,558,178,400	
	ヒューリックリート投資法人	7,630	1,435,966,000	
	日本リート投資法人	2,990	1,320,085,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	58,490	1,326,553,200	
	積水ハウス・リート投資法人	27,072	2,612,448,000	
	トーセイ・リート投資法人	2,036	292,573,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	3,661	1,097,567,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	1,963	306,816,900	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,772	230,005,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	29,764	5,271,204,400	
	いちごホテルリート投資法人	1,609	156,073,000	
	ラサールロジポート投資法人	11,134	2,174,470,200	
	スターアジア不動産投資法人	9,457	608,085,100	
	マリモ地方創生リート投資法人	862	115,077,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,212	1,917,564,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,486	127,944,600		

投資法人みらい	9,940	553,658,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,993	280,614,400	
三菱地所物流リート投資法人	2,315	1,113,515,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	2,945	587,822,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,410	177,660,000	
タカラレーベン不動産投資法人	2,766	362,899,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,570	586,551,000	
日本ビルファンド投資法人	10,359	7,292,736,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,204	6,461,208,000	
日本都市ファンド投資法人	45,846	5,432,751,000	
オリックス不動産投資法人	18,339	3,900,705,300	
日本プライムリアルティ投資法人	5,730	2,481,090,000	
N T T 都市開発リート投資法人	8,313	1,371,645,000	
東急リアル・エステート投資法人	6,171	1,261,969,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,391	811,017,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	19,684	3,330,532,800	
森トラスト総合リート投資法人	6,578	1,055,769,000	
インヴィンシブル投資法人	38,486	1,758,810,200	
フロンティア不動産投資法人	3,227	1,658,678,000	
平和不動産リート投資法人	5,947	1,066,297,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,014	2,029,725,000	
福岡リート投資法人	4,760	888,216,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	2,847	2,263,365,000	
いちごオフィスリート投資法人	7,542	751,937,400	
大和証券オフィス投資法人	1,946	1,547,070,000	
阪急阪神リート投資法人	4,157	715,419,700	
スターツプロシード投資法人	1,433	360,542,800	
大和ハウスリート投資法人	13,132	4,215,372,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,652	2,010,405,600	
大和証券リビング投資法人	12,019	1,490,356,000	
ジャパンエクセレント投資法人	8,541	1,332,396,000	
合計	578,006	108,677,185,200	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	283,310,998
コール・ローン	34,345,067
投資証券	93,684,589,683
未収入金	1,097,099
未収配当金	306,860,242
流動資産合計	94,310,203,089
資産合計	94,310,203,089
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,501
未払株式払込金	3,471,644
未払解約金	50,482,858
未払利息	52
流動負債合計	54,014,055
負債合計	54,014,055
純資産の部	
元本等	
元本	41,364,083,335
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	52,892,105,699
元本等合計	94,256,189,034
純資産合計	94,256,189,034
負債純資産合計	94,310,203,089

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>



2021年 7月12日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,364,083,335口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2787円 (1万口当たり純資産額) (22,787円)

## ( 金融商品に関する注記 )

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2021年 7月12日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	56,703,060,151円
期中追加設定元本額	5,933,734,007円
期中一部解約元本額	21,272,710,823円
期末元本額	41,364,083,335円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	71,453,859円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	111,784,396円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,674,023,062円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,558,605円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,895,193,707円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,452,704,405円
コア投資戦略ファンド（安定型）	878,873,279円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,924,492,863円
分散投資コア戦略ファンドA	345,347,104円
分散投資コア戦略ファンドS	767,067,340円
コア投資戦略ファンド（切替型）	781,748,503円
SMT インデックスバランス・オープン	151,113,822円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	268,792,026円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,782,584円
グローバル経済コア	263,391,588円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,128,689円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	408,099,388円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,971,190円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,152,266,960円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	428,372,456円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	93,284,369円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	4,065,754円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	126,865,565円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	129,296,887円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	124,909,598円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	124,042,433円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	120,452,903円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		18,775,970,474
合計		18,775,970,474

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

(2021年 7月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,279,300	-	25,338,801	59,501
	アメリカドル	25,279,300	-	25,338,801	59,501
合計		25,279,300	-	25,338,801	59,501

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	46,940	1,025,639.00	
		AGREE REALTY CORP	38,105	2,759,945.15	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	765,719.40	

ALEXANDER'S INC	1,190	321,311.90	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,750	14,434,162.50	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	27,157	1,026,263.03	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	74,992	3,694,105.92	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	495,788.80	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,482	6,288,357.68	
AMERICOLD REALTY TRUST	138,199	5,409,108.86	
APARTMENT INCOME REIT CO	86,759	4,333,612.05	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	76,106	547,202.14	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	1,735,480.64	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	412,360.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,519	17,118,520.77	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	156,964.50	
BOSTON PROPERTIES	79,055	9,262,874.35	
BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	1,305,999.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	162,046	3,757,846.74	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,126,318.70	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	24,100	457,418.00	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	88,550.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	53,609	7,568,518.62	
CARETRUST REIT INC	52,477	1,245,803.98	
CENTERSPACE	7,499	616,267.82	
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	315,732.00	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	13,000	112,450.00	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	306,612.00	
CLIPPER REALTY INC	7,300	57,743.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	60,331	1,035,883.27	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,605	574,215.40	
COREPOINT LODGING INC	22,000	247,280.00	
CORESITE REALTY CORP	23,959	3,314,248.47	
CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	1,852,453.47	
COUSINS PROPERTIES INC	83,426	3,176,862.08	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	154,140.00	
CUBESMART	112,530	5,458,830.30	
CYRUSONE INC	67,819	5,059,975.59	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	1,073,856.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	156,215	24,332,048.40	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	263,096	2,023,208.24	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	547,136.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	92,547	3,163,256.46	
DUKE REALTY CORP	208,631	10,400,255.35	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	40,415.00	

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	1,027,245.40
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,329	3,819,598.74
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	993,695.50
EPR PROPERTIES	41,912	2,206,247.68
EQUINIX INC	49,526	40,627,168.32
EQUITY COMMONWEALTH	67,845	1,818,246.00
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,289	7,405,458.06
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	189,646	15,495,974.66
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	1,783,501.16
ESSEX PROPERTY TRUST	36,145	11,575,074.80
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,703	12,764,622.57
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	152,012.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,320	4,641,726.00
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	70,298	3,796,092.00
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	40,250	1,159,602.50
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	306,677.17
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	121,511	5,692,790.35
GEO GROUP INC/THE	64,306	459,144.84
GETTY REALTY CORP	21,985	712,094.15
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	454,987.00
GLADSTONE LAND CORP	15,500	362,390.00
GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	419,006.60
GLOBAL NET LEASE INC	51,412	955,749.08
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	78,310	2,401,767.70
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	119,276	3,251,463.76
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,842	10,422,507.92
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	223,861.00
HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,422	2,696,759.52
HOST HOTELS AND RESORTS INC	393,361	6,730,406.71
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	2,365,661.60
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,131	1,121,715.07
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,941	1,009,230.60
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,388	2,730,884.24
INVITATION HOMES INC	314,773	12,559,442.70
IRON MOUNTAIN INC	158,471	6,931,521.54
JBG SMITH PROPERTIES	62,238	1,981,657.92
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	350,000	281,750.00
KILROY REALTY CORPORATION	57,829	4,091,401.75
KIMCO REALTY CORP	239,966	5,089,678.86
KITE REALTY GROUP TRUST	46,370	996,955.00
LEXINGTON CORP PROPERTIES	152,908	1,874,652.08

LIFE STORAGE INC	42,485	4,843,290.00
LTC PROPERTIES INC	20,326	792,104.22
MACERICH CO/THE	92,542	1,654,650.96
MACK-CALI REALTY CORP	50,236	880,637.08
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	589,251.20
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	328,046	6,724,943.00
MID-AMERICA APARTMENT COMM	63,511	11,476,437.70
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	1,028,701.44
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	95,939	4,573,412.13
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	38,720	2,040,544.00
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	1,687,022.00
NETSTREIT CORP	14,992	366,854.24
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	406,800.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	707,164.12
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	806,791.70
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	130,489	4,852,885.91
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	250,660.85
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	908,027.12
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	133,133	2,616,063.45
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	1,647,099.00
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	78,750.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	2,209,995.68
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	1,273,575.00
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	330,243.00
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	302,614.19
PRIME US REIT	295,000	250,750.00
PROLOGIS INC	409,939	51,402,251.21
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	1,713,449.64
PUBLIC STORAGE	84,437	26,317,324.16
QTS REALTY TRUST INC	38,049	2,953,363.38
REALTY INCOME CORP	207,543	14,293,486.41
REGENCY CENTERS CORP	87,710	5,702,027.10
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	62,989	1,116,794.97
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	115,918	1,343,489.62
RETAIL VALUE	9,529	205,921.69
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	73,995	4,347,946.20
RLJ LODGING TRUST	92,291	1,328,067.49
RPT REALTY	43,950	570,031.50
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	2,390,911.44
SABRA HEALTH CARE REIT INC	118,636	2,199,511.44
SAFEHOLD INC	8,340	700,643.40

	SAUL CENTERS INC	6,800	310,216.00
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	344,668.00
	SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	1,176,170.81
	SIMON PROPERTY GROUP	182,255	23,636,650.95
	SITE CENTERS CORP	91,820	1,390,154.80
	SL GREEN REALTY CORP	38,945	3,068,476.55
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,982	3,116,563.22
	STAG INDUSTRIAL INC	89,179	3,481,548.16
	STORE CAPITAL CORP	135,047	4,846,836.83
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	581,385.20
	SUN COMMUNITIES INC	62,196	11,249,390.52
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	116,130	1,401,689.10
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	1,087,161.50
	TERRENO REALTY CORP	38,649	2,582,139.69
	UDR INC	163,050	8,472,078.00
	UMH PROPERTIES INC	21,320	469,679.60
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	431,558.97
	URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	1,133,559.00
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	287,906.50
	VENTAS INC	208,066	12,200,990.24
	VEREIT INC	127,247	6,062,047.08
	VICI PROPERTIES INC	295,341	9,285,521.04
	VORNADO REALTY TRUST	85,675	3,985,601.00
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	45,570	1,112,819.40
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	66,885	2,177,106.75
	WELLTOWER INC	231,721	20,027,646.03
	WHITESTONE REIT	19,090	154,819.90
	WP CAREY INC	98,450	7,676,146.50
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	1,162,903.50
	アメリカドル 小計	13,867,875	638,389,085.61 (70,331,325,561)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	1,566,423.30
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	471,861.00
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	152,640.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	626,935.40
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,320	2,838,952.80
	CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	1,282,209.60
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	633,511.80
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	489,548.34
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	472,796.50
		51,250	825,125.00



DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR			
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	322,420.60	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	1,047,741.10	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,805	1,539,242.25	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,039	1,377,663.00	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	40,490	724,771.00	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	628,939.50	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	273,171.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	229,313.10	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,470	632,048.80	
PLAZA RETAIL REIT	25,000	115,000.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	83,631	1,923,513.00	
SLATE GROCERY REIT	10,300	136,475.00	
SLATE OFFICE REI	17,000	91,800.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	37,476	1,140,769.44	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	867,150.00	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	192,726.00	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	539,795.00	
カナダドル 小計	976,675	21,142,542.53 (1,869,846,461)	
ユーロ			
AEDIFICA	19,825	2,337,367.50	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	98,200	1,639,940.00	
ALTAREA	2,230	422,362.00	
BEFIMMO S.C.A.	14,010	505,060.50	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	416,250.00	
CARMILA	25,000	296,500.00	
COFINIMMO	16,333	2,172,289.00	
COVIVIO(FP)	26,742	2,072,505.00	
CROMWELL REIT EUR	160,000	403,200.00	
EUROCOMMERCIAL	20,783	456,394.68	
GECINA SA	30,422	4,041,562.70	
HAMBORNER REIT AG	37,000	341,547.00	
HIBERNIA REIT PLC	365,550	470,828.40	
ICADE	17,080	1,295,518.00	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	141,411.15	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,062	1,275,200.48	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	298,870.00	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	416,000.00	

	KLEPIERRE	111,130	2,462,640.80
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	179,860.00
	MERCIALYS	19,000	202,160.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	180,986	1,675,930.36
	MONTEA NV	5,300	562,860.00
	NSI NV	10,050	361,297.50
	RETAIL ESTATES	6,400	472,320.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	77,158	5,820,027.94
	VASTNED RETAIL	10,650	278,497.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	75,470	2,588,621.00
	WERELDHAVE NV	22,670	340,276.70
	XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	559,584.00
	ユーロ 小計	1,858,381	34,506,882.21 (4,514,190,330)
イギリスポ ンド	AEW UK REIT PLC	118,000	117,292.00
	ASSURA PLC	1,467,040	1,123,019.12
	BIG YELLOW GROUP PLC	89,146	1,240,912.32
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	435,000	408,900.00
	BRITISH LAND CO PLC	524,845	2,704,001.44
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	810,321.73
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	384,197.98
	CUSTODIAN REIT PLC	234,276	233,104.62
	DERWENT LONDON PLC	61,915	2,157,118.60
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	277,542.00
	GCP STUDENT LIVING PLC	264,000	512,160.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	144,780	1,088,745.60
	HAMMERSON PLC	2,291,000	884,326.00
	HOME REIT PLC	132,934	150,880.09
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	204,312.96
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	419,205	2,887,484.04
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	1,222,252.96
	LXI REIT PLC	344,008	491,931.44
	NEWRIVER REIT PL	186,000	161,820.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	309,540.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	1,153,829.70
	REGIONAL REIT LTD	222,000	200,910.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	1,185,898.14
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	172,550.00
	SEGRO PLC	660,723	7,694,119.33
SHAFTESBURY PLC	168,693	1,026,496.90	
STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	190,351.88	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	552,210.00	

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	213,043.72	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	947,658	1,959,756.74	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	392,000	315,560.00	
	UNITE GROUP PLC	221,192	2,533,754.36	
	WORKSPACE GROUP PLC	70,347	601,466.85	
	イギリスポンド 小計	14,153,068	35,179,080.52 (5,386,269,018)	
オーストラ リアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	744,691.20	
	APN INDUSTRIA REIT	75,000	250,500.00	
	ARENA REIT	201,053	743,896.10	
	AVENTUS GROUP	193,500	607,590.00	
	BWP TRUST	254,160	1,082,721.60	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	321,000	959,790.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	266,606	989,108.26	
	CENTURIA OFFICE REIT	220,945	536,896.35	
	CHARTER HALL GROUP	258,140	3,926,309.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,312	1,436,242.56	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	1,092,830.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	687,340.50	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	1,102,633	992,369.70	
	DEXUS	590,307	6,097,871.31	
	GDI PROPERTY GROUP	324,500	356,950.00	
	GOODMAN GROUP	926,628	19,774,241.52	
	GPT GROUP	1,055,317	5,107,734.28	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	662,037.20	
	HOME CONSORTIUM	91,000	487,760.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	400,276.58	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	268,547.40	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	940,728.00	
	IRONGATE GROUP	272,000	402,560.00	
	MIRVAC GROUP	2,193,770	6,427,746.10	
	NATIONAL STORAGE REIT	601,340	1,250,787.20	
	RURAL FUNDS GROUP	212,766	529,787.34	
SCENTRE GROUP	2,887,179	7,824,255.09		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	1,398,293.40		
STOCKLAND	1,308,941	5,929,502.73		
VICINITY CENTERS	2,158,040	3,355,752.20		
WAYPOINT REIT LTD	455,796	1,189,627.56		
	オーストラリアドル 小計	18,243,294	76,454,743.98 (6,297,577,261)	
ニュージ ーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	848,849.82	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	1,464,732.00	

	KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	1,017,310.65	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	682,894	1,160,919.80	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	738,168.44	
	ニュージーランドドル 小計	2,867,311	5,229,980.71 (402,656,214)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,138,000	4,973,060.00	
	FORTUNE REIT	756,000	6,357,960.00	
	LINK REIT	1,146,400	85,005,560.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	2,256,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	2,642,310.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	3,247,460.00	
	香港ドル 小計	5,171,400	104,482,350.00 (1,481,559,723)	
シンガポ ールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	431,750.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	655,579.76	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,819,618	5,477,050.18	
	ASCOTT TRUST	991,877	1,051,389.62	
	CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	695,577.77	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,477,444	5,301,730.16	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	525,672.00	
	EC WORLD REIT	180,000	146,700.00	
	ESR REIT	1,404,065	631,829.25	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	318,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	142,596.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	734,262	1,820,969.76	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	241,500.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,581,096	2,355,833.04	
	IREIT GLOBAL	405,985	259,830.40	
	KEPPEL DC REIT	688,603	1,776,595.74	
	KEPPEL REIT	1,051,400	1,251,166.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	485,625.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,480,400	158,745.60	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,210,473	2,650,935.87	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,073,963	3,071,534.18	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,618,200	3,398,220.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,212,100	1,248,463.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	554,035.14	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	203,000	956,130.00		
SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	205,772.20		

	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	286,926.00	
	SPH REIT	576,800	533,540.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	859,400	507,046.00	
	SUNTEC REIT	1,180,700	1,794,664.00	
	シンガポールドル 小計	27,835,368	38,936,007.17 (3,174,452,664)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	418,340,250.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	63,691,980.00	
	JR REIT XXVII	64,338	340,348,020.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	123,800,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	433,430,400.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	199,932,250.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	149,880,050.00	
	韓国ウォン 小計	284,799	1,729,422,950.00 (166,370,487)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	103,500	1,794,690.00	
	イスラエルシェケル 小計	103,500	1,794,690.00 (60,341,964)	
	合計	85,361,671	93,684,589,683 (93,684,589,683)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 156銘柄	100.0%	75.1%
カナダドル	投資証券 27銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	4.8%
イギリスポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.7%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券 7銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	265,631,875
コール・ローン	303,118,513
社債券	19,445,506,273
流動資産合計	20,014,256,661
資産合計	20,014,256,661
負債の部	
流動負債	
未払解約金	319,000
未払利息	462
流動負債合計	319,462
負債合計	319,462
純資産の部	
元本等	
元本	52,438,950,106
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,425,012,907
元本等合計	20,013,937,199
純資産合計	20,013,937,199
負債純資産合計	20,014,256,661

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2021年 7月12日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,438,950,106口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 32,425,012,907円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.3817円 (1万口当たり純資産額) (3,817円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2021年 7月12日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。



## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	80,389,097,985円
期中追加設定元本額	4,875,413,197円
期中一部解約元本額	32,825,561,076円
期末元本額	52,438,950,106円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	38,256,168,956円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,678,129,478円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,864,539,915円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,531,251,194円
SMTAMコモディティ・オープン	1,942,100,760円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	663,375,528円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	75,100,783円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	2,411,114,317円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,017,169,175円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	450,372,757
合計	450,372,757

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 038 08/31/21	7,000,000.00	9,187,850.00	
		CS USD COM 017 07/30/21	7,000,000.00	9,474,500.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	3,860,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	4,036,500.00	
		SG ISSUER 021 11/30/21	11,000,000.00	13,852,300.00	
		SG ISSUER 022 01/31/22	15,000,000.00	17,305,500.00	
		SG ISSUER 023 03/31/22	21,000,000.00	23,438,100.00	
		SG ISSUER 024 05/31/22	19,000,000.00	19,115,900.00	
		STAR HELIOS 008 10/22/21	59,000,000.00	76,233,900.00	
	アメリカドル 小計		194,000,000.00	176,504,550.00 (19,445,506,273)	
合計				19,445,506,273 (19,445,506,273)	

### 有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 9銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,719,731
コール・ローン	106,703,091
投資信託受益証券	35,718,965,831
派生商品評価勘定	287,627,218
流動資産合計	36,120,015,871
資産合計	36,120,015,871
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,850,289
未払利息	162
流動負債合計	5,850,451
負債合計	5,850,451
純資産の部	
元本等	
元本	28,562,552,203
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,551,613,217
元本等合計	36,114,165,420
純資産合計	36,114,165,420
負債純資産合計	36,120,015,871

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2021年 7月12日現在
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,562,552,203口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 1.2644円 (1万口当たり純資産額) (12,644円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月12日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	22,572,469,512円
期中追加設定元本額	9,867,819,725円

区分	2021年 7月12日現在
期中一部解約元本額	3,877,737,034円
期末元本額	28,562,552,203円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,248,503,799円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,329,169,406円
分散投資コア戦略ファンドA	3,137,168,962円
分散投資コア戦略ファンドS	12,026,495,095円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,376,230,479円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	531,632,248円
グローバル経済コア	1,187,625,868円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,241,421,226円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	557,552,669円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	67,659,411円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	138,698,918円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,720,394,122円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	352,728,678
合計	352,728,678

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	35,023,344,558	-	34,735,717,340	287,627,218
	アメリカドル	35,023,344,558	-	34,735,717,340	287,627,218
合計		35,023,344,558	-	34,735,717,340	287,627,218

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	9,416,695	324,216,808.85	
		アメリカドル 小計	9,416,695	324,216,808.85 (35,718,965,831)	
合計			9,416,695	35,718,965,831 (35,718,965,831)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 米国株式LSマザーファンド

## 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	364,972,470
社債券	17,984,693,717
派生商品評価勘定	53,806,300
流動資産合計	18,403,472,487
資産合計	18,403,472,487
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,565,284
未払利息	556
流動負債合計	4,565,840
負債合計	4,565,840
純資産の部	
元本等	
元本	18,944,877,100
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	545,970,453
元本等合計	18,398,906,647
純資産合計	18,398,906,647
負債純資産合計	18,403,472,487

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。



2021年 7月12日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,944,877,100口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 545,970,453円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9712円 (1万口当たり純資産額) (9,712円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2021年 7月12日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	23,891,809,833円
期中追加設定元本額	4,111,127,112円
期中一部解約元本額	9,058,059,845円
期末元本額	18,944,877,100円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,868,581,812円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,194,805,213円
コア投資戦略ファンド（切替型）	856,603,646円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	347,642,415円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	12,253,598,460円
米国株式LSファンド（SMA専用）	495,037,942円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	295,448,402円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,174,763円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	601,984,447円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	442,249,041
合計	442,249,041

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式LSマザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2021年 7月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	18,005,208,200	-	17,951,401,900	53,806,300
	アメリカドル	18,005,208,200	-	17,951,401,900	53,806,300
合計		18,005,208,200	-	17,951,401,900	53,806,300

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/22	154,000,000.00	163,244,928.00	
		アメリカドル 小計	154,000,000.00	163,244,928.00 (17,984,693,717)	
合計				17,984,693,717 (17,984,693,717)	

## 有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## コモディティLSアルファ・マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	209,012,255
社債券	20,363,101,000
流動資産合計	20,572,113,255
資産合計	20,572,113,255
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,384,586
未払利息	318
流動負債合計	1,384,904
負債合計	1,384,904
純資産の部	
元本等	
元本	18,197,417,712
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	2,373,310,639
元本等合計	20,570,728,351
純資産合計	20,570,728,351
負債純資産合計	20,572,113,255

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,197,417,712口

		2021年 7月12日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1304円 (11,304円)	

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		2021年 7月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。		
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。		

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2021年 7月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。		
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。		

	2021年 7月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月11日
期首元本額	12,609,230,404円
期中追加設定元本額	6,854,538,950円
期中一部解約元本額	1,266,351,642円
期末元本額	18,197,417,712円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,766,479,321円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,067,900,925円
コア投資戦略ファンド（切替型）	843,205,185円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	325,142,098円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	11,954,581,336円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	275,252,897円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,841,868円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	353,628,251円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	579,385,831円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		249,227,000
合計		249,227,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「コモディティLSアルファ・マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	STAR HELIOS 0% 07/13/22	17,930,000,000	20,363,101,000	
	合計	17,930,000,000	20,363,101,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

項目	2021年 7月12日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		886,001,346
社債券		18,025,929,000



	2021年 7月12日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	18,911,930,346
資産合計	18,911,930,346
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,409,251
未払利息	1,352
流動負債合計	1,410,603
負債合計	1,410,603
純資産の部	
元本等	
元本	21,125,701,112
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,215,181,369
元本等合計	18,910,519,743
純資産合計	18,910,519,743
負債純資産合計	18,911,930,346

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2021年 7月12日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 7月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,125,701,112口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,215,181,369円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8951円 (1万口当たり純資産額) (8,951円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 7月12日現在

1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2021年 7月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 10月6日
期首元本額	495,000円
期中追加設定元本額	21,314,923,722円
期中一部解約元本額	189,717,610円
期末元本額	21,125,701,112円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	620,000,000円
コア投資戦略ファンド（成長型）	755,000,000円
分散投資コア戦略ファンドA	2,026,367,965円
分散投資コア戦略ファンドS	8,997,719,621円
コア投資戦略ファンド（切替型）	280,000,000円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	159,246,941円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	6,835,083,213円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	100,000,000円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,350,833円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（SMA専用）	257,979,579円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	205,748,207円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	877,204,753円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年 7月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
社債券	351,701,000
合計	351,701,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	STAR HELIOS 0% 10/18/ 21	20,170,000,000	18,025,929,000	
合計		20,170,000,000	18,025,929,000	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

## 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(2021年7月13日から2022年1月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2021年7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年1月12日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	740,133,326	796,476,960
投資信託受益証券	16,809,672,696	17,536,037,526
投資証券	1,691,487,423	2,187,159,964
親投資信託受益証券	30,824,364,901	27,066,438,937
未収入金	69,629,894	-
流動資産合計	50,135,288,240	47,586,113,387
<b>資産合計</b>		
	50,135,288,240	47,586,113,387
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	74,054,499	56,971,399
未払受託者報酬	14,298,977	13,404,429
未払委託者報酬	380,352,982	356,557,669
未払利息	1,129	880
その他未払費用	887,400	882,513
流動負債合計	469,594,987	427,816,890
<b>負債合計</b>		
	469,594,987	427,816,890
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	40,873,495,259	38,372,178,454
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	8,792,197,994	8,786,118,043
(分配準備積立金)	4,500,409,447	4,159,222,183
元本等合計	49,665,693,253	47,158,296,497
<b>純資産合計</b>		
	49,665,693,253	47,158,296,497
<b>負債純資産合計</b>		
	50,135,288,240	47,586,113,387

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 2020年 7月11日 至 2021年 1月10日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
営業収益		
受取利息	1,645	2,303
有価証券売買等損益	3,757,504,827	923,814,687
営業収益合計	3,757,506,472	923,816,990
営業費用		
支払利息	133,180	143,636
受託者報酬	15,571,226	13,404,429
委託者報酬	414,194,653	356,557,669
その他費用	904,181	882,513
営業費用合計	430,803,240	370,988,247
営業利益又は営業損失（ ）	3,326,703,232	552,828,743
経常利益又は経常損失（ ）	3,326,703,232	552,828,743
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,326,703,232	552,828,743
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	147,208,486	25,375,358
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,794,129,241	8,792,197,994
剰余金増加額又は欠損金減少額	49,783,588	138,048,083
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	49,783,588	138,048,083
剰余金減少額又は欠損金増加額	407,951,398	671,581,419
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	407,951,398	671,581,419
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,615,456,177	8,786,118,043

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第10期中間計算期間は2021年 7月13日から2022年 1月12日までとなっております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,873,495,259口	38,372,178,454口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2151円 (1万口当たり純資産額) (12,151円)	1口当たり純資産額 1.2290円 (1万口当たり純資産額) (12,290円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項



	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	51,696,161,551円	40,873,495,259円
期中追加設定元本額	865,618,090円	620,231,605円
期中一部解約元本額	11,688,284,382円	3,121,548,410円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(2021年7月13日から2022年1月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2021年7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年1月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,233,608,553	1,085,282,585
投資信託受益証券	19,527,849,095	21,612,446,662
投資証券	1,849,695,961	2,938,055,816
親投資信託受益証券	50,583,256,273	44,346,123,987
未収入金	178,577,900	69,944,435
流動資産合計	73,372,987,782	70,051,853,485
<b>資産合計</b>		
73,372,987,782		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	277,882,039	61,458,761
未払受託者報酬	20,542,678	19,627,734
未払委託者報酬	546,435,120	522,097,511
未払利息	1,882	1,200
その他未払費用	949,831	944,746
流動負債合計	845,811,550	604,129,952
<b>負債合計</b>		
845,811,550		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	50,857,692,096	47,676,009,699
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	21,669,484,136	21,771,713,834
(分配準備積立金)	9,950,893,116	9,163,803,573
元本等合計	72,527,176,232	69,447,723,533
<b>純資産合計</b>		
72,527,176,232		
<b>負債純資産合計</b>		
73,372,987,782		

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 2020年 7月11日 至 2021年 1月10日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
営業収益		
受取利息	2,382	3,425
有価証券売買等損益	7,068,674,433	2,052,363,687
営業収益合計	7,068,676,815	2,052,367,112
営業費用		
支払利息	198,968	211,600
受託者報酬	22,228,222	19,627,734
委託者報酬	591,270,832	522,097,511
その他費用	970,756	944,746
営業費用合計	614,668,778	542,881,591
営業利益又は営業損失（ ）	6,454,008,037	1,509,485,521
経常利益又は経常損失（ ）	6,454,008,037	1,509,485,521
中間純利益又は中間純損失（ ）	6,454,008,037	1,509,485,521
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	347,525,137	63,024,985
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	14,817,959,565	21,669,484,136
剰余金増加額又は欠損金減少額	139,197,595	384,446,395
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	139,197,595	384,446,395
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,366,592,126	1,728,677,233
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,366,592,126	1,728,677,233
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	19,697,047,934	21,771,713,834

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第10期中間計算期間は2021年 7月13日から2022年 1月12日までとなっております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第9期 (2021年 7月12日現在)	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	50,857,692,096口	47,676,009,699口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4261円 (1万口当たり純資産額) (14,261円)	1口当たり純資産額 1.4567円 (1万口当たり純資産額) (14,567円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第10期中間計算期間 (2022年 1月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	第9期 自 2020年 7月11日 至 2021年 7月12日	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	64,747,963,686円	50,857,692,096円
期中追加設定元本額	1,202,439,160円	874,910,045円
期中一部解約元本額	15,092,710,750円	4,056,592,442円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資

信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,793,843,532
株式	498,456,743,930
派生商品評価勘定	43,463,050
未収入金	188,900
未収配当金	671,733,733
差入委託証拠金	186,595,000
流動資産合計	502,152,568,145
資産合計	502,152,568,145
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,511,600
前受金	40,965,200
未払解約金	14,911,758
未払利息	3,090
流動負債合計	58,391,648
負債合計	58,391,648
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	254,912,335,585
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	247,181,840,912
元本等合計	502,094,176,497
純資産合計	502,094,176,497
負債純資産合計	502,152,568,145

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  先物取引

2022年 1月12日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	254,912,335,585口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.9697円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (19,697円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月12日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

	2022年 1月12日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	251,095,419,520円
期中追加設定元本額	15,280,837,513円
期中一部解約元本額	11,463,921,448円
期末元本額	254,912,335,585円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	409,148,377円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,912,217,633円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,706,836円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,110,098,633円
世界経済インデックスファンド	3,468,960,234円
日本株式インデックス・オープン	3,380,060,608円
DCマイセレクション25	6,095,117,706円
DCマイセレクション50	18,213,271,233円
DCマイセレクション75	18,384,403,235円
DC日本株式インデックス・オープン	6,009,404,826円
DCマイセレクションS25	3,010,347,389円
DCマイセレクションS50	8,772,925,494円
DCマイセレクションS75	6,481,795,000円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,987,333,593円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	223,802,659円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	700,161,634円



区分	2022年 1月12日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	502,471,126円
DC世界経済インデックスファンド	3,446,023,676円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,684,014,069円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	5,883,786円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	18,858,291円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	20,644,035円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	190,402,821円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,239,914円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	33,959,121円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	127,038,697円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	25,932,294円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	85,912,603円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	980,241,278円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	446,910,304円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,923,370,310円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	82,540,954円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	26,535,537円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	512,973,451円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	284,154,590円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	367,514,708円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	37,133,693円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	594,149,189円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,528,653,872円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,898,234,978円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,344,624,777円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,711,030,971円
分散投資コア戦略ファンドA	1,375,097,034円
分散投資コア戦略ファンドS	5,791,455,986円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	448,635,304円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	407,357,050円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,995,884,669円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	216,662,052円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,730,001円
SMT インデックスバランス・オープン	58,330,055円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	26,688,154,154円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	559,164,334円
SMT 世界経済インデックス・オープン	41,435,161円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	149,231,141円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	28,210,413円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,252,198円
グローバル経済コア	215,936,253円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	25,332,753円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	87,104,996円

区分	2022年 1月12日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	20,538,695円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,270,588,596円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	167,409,376円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,344,728円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	4,286,783円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2,215,109円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2,359,610円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,851,783,952円
F O F s用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,051,294,071円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	251,825,101円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	44,545,867円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	85,775,952円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	47,752,560,249円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	10,373,557円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	228,256,250円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,290,384,800	-	3,331,350,000	40,965,200
合計		3,290,384,800	-	3,331,350,000	40,965,200

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 日本債券ツイン戦略マザーファンド

#### 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	843,395,357
国債証券	15,229,279,000
社債券	50,902,829,000
コール・オプション(買)	25,149,000

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
プット・オプション（買）	26,344,000
派生商品評価勘定	31,387,130
未収入金	1,948,000
未収利息	135,725,792
前払費用	5,486,145
差入委託証拠金	19,240,000
流動資産合計	67,220,783,424
資産合計	67,220,783,424
負債の部	
流動負債	
コール・オプション（売）	4,954,000
プット・オプション（売）	89,734,000
派生商品評価勘定	654,290
前受金	30,750,000
未払金	28,484,000
未払解約金	30,514,051
未払利息	932
流動負債合計	185,091,273
負債合計	185,091,273
純資産の部	
元本等	
元本	67,129,954,734
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	94,262,583
元本等合計	67,035,692,151
純資産合計	67,035,692,151
負債純資産合計	67,220,783,424

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> <p>(2) 債券店頭オプション取引</p>

	2022年 1月12日現在
3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	67,129,954,734口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 94,262,583円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9986円 (1万口当たり純資産額) (9,986円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>

	2022年 1月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	67,304,440,043円
期中追加設定元本額	5,228,276,538円
期中一部解約元本額	5,402,761,847円
期末元本額	67,129,954,734円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,035,330,425円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,601,363,056円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	45,712,956,569円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,132,003,343円
債券コア戦略ファンド	751,979,121円
債券コア・セレクション	3,596,797,135円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	198,193,804円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	24,716,618円
日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,497,610,875円
F O F s 用 日本債券ツイン戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	1,065,533,602円
私募日本債券ツイン戦略ファンド（適格機関投資家専用）	6,513,470,186円

## （デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	7,885,350,000	-	7,854,600,000	30,750,000
市場取引以外の取引	債券店頭オプション取引				
	買建				
	コール	7,461,372,000	-	25,149,000	15,012,000
	プット	15,952,383,000	-	26,344,000	12,971,000
	売建				
	コール	15,952,383,000	-	4,954,000	2,806,000
	プット	7,461,372,000	-	89,734,000	68,465,000
	合計	54,712,860,000	-	8,000,781,000	6,926,000

## (注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

債券店頭オプション取引の時価については、金融商品取引業者又は銀行等が提示する価額若しくは価格情報会社の提供する価額で評価しております。

## 2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

債券店頭オプション取引の契約額等は、行使価格ベースで表示しております。

## 3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	11,569,813,098
コール・ローン	590,630,268
株式	517,348,931,867
投資信託受益証券	289,633,995
投資証券	11,848,677,775
派生商品評価勘定	129,941,852
未収入金	407,939
未収配当金	362,927,831
差入委託証拠金	1,652,866,107
流動資産合計	543,793,830,732
資産合計	543,793,830,732
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,089,658
前受金	122,092,810
未払解約金	342,624,364
未払利息	653

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	472,807,485
負債合計	472,807,485
純資産の部	
元本等	
元本	126,388,032,327
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	416,932,990,920
元本等合計	543,321,023,247
純資産合計	543,321,023,247
負債純資産合計	543,793,830,732

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2022年 1月12日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	126,388,032,327口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.2988円 (1万口当たり純資産額) (42,988円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。



	2022年 1月12日現在
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	137,442,391,078円
期中追加設定元本額	7,110,885,134円
期中一部解約元本額	18,165,243,885円
期末元本額	126,388,032,327円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,891,762,243円
S B I 資産設計オープン（分配型）	7,092,804円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	30,002,379,096円
世界経済インデックスファンド	9,591,360,832円
外国株式インデックス・オープン	843,226,061円

区分	2022年 1月12日現在
D Cマイセレクション2 5	820,086,465円
D Cマイセレクション5 0	3,845,003,450円
D Cマイセレクション7 5	4,403,353,647円
D C外国株式インデックス・オープン	11,634,911,297円
D CマイセレクションS 2 5	397,745,316円
D CマイセレクションS 5 0	1,820,498,982円
D CマイセレクションS 7 5	1,524,272,954円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	52,466,797円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	165,407,612円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	118,682,719円
D C世界経済インデックスファンド	9,583,721,707円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,679,053,410円
マイセレクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	4,135,155円
マイセレクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	4,613,649円
外国株式インデックス・オープンV A 1(適格機関投資家専用)	30,790,065円
バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	16,645,660円
バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	59,529,571円
バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	11,656,656円
バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	38,621,871円
バランスA(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	316,336,596円
バランスB(3 7. 5)V A 1(適格機関投資家専用)	186,733,308円
バランスC(5 0)V A 1(適格機関投資家専用)	1,370,578,580円
世界バランスV A 1(適格機関投資家専用)	184,622,985円
世界バランスV A 2(適格機関投資家専用)	35,625,550円
バランスD(3 5)V A 1(適格機関投資家専用)	181,956,985円
バランスE(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	60,913,654円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,153,399,892円
F O F s用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,207,148,164円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,153,378,632円
コア投資戦略ファンド(安定型)	709,679,705円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,532,976,315円
分散投資コア戦略ファンドA	1,458,128,299円
分散投資コア戦略ファンドS	8,127,220,507円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,245,950,201円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,082,122,391円
コア投資戦略ファンド(切替型)	651,450,787円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	604,522,822円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	29,685,039円
S M T インデックスバランス・オープン	159,679,384円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	431,357,615円
外国株式S M T Bセレクション(SMA専用)	18,442,493,395円
S M T 世界経済インデックス・オープン	173,749,675円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	638,583,403円

区分	2022年 1月12日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	124,486,649円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	3,770,269円
i - S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	151,011,141円
グローバル経済コア	650,696,969円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	12,528,845円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	4,851,911円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	480,458,252円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	62,506,125円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	17,846,419円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	12,037,372円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	6,172,110円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	6,743,385円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	342,392,345円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	514,553,693円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,056,969,575円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,087,925,268円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	193,549,637円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,479,151円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	44,337,473円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	79,923,650円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 01（適格機関投資家専用）	269,423,198円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 05（適格機関投資家専用）	260,033,035円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 08（適格機関投資家専用）	252,448,023円
S M T A M海外バランスファンド2020 - 11（適格機関投資家専用）	250,931,421円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 04（適格機関投資家専用）	259,631,356円
S M T A M海外バランスファンド2021 - 07（適格機関投資家専用）	255,658,802円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021 - 11（適格機関投資家専用）	194,354,350円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,584,967,928	-	9,707,060,738	122,092,810
合計		9,584,967,928	-	9,707,060,738	122,092,810

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	205,287,400	-	205,303,064	15,664
	アメリカドル	205,287,400	-	205,303,064	15,664
	売建	4,002,455,400	-	4,002,711,680	256,280
	アメリカドル	2,848,651,000	-	2,848,838,720	187,720
	カナダドル	458,820,000	-	458,841,000	21,000
	ユーロ	380,410,400	-	380,457,960	47,560
	イギリスポンド	314,574,000	-	314,574,000	-
合計		4,207,742,800	-	4,208,014,744	240,616

### (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	117,806,590
コール・ローン	5,149,668,698
国債証券	301,405,992,432
派生商品評価勘定	348,918
未収入金	105,713,688
未収利息	1,712,797,460
前払金	82,153,575
前払費用	86,337,598
差入委託証拠金	405,374,421
流動資産合計	309,066,193,380
資産合計	309,066,193,380
負債の部	
流動負債	

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	82,570,693
未払金	1,806,097
未払解約金	21,019,042
未払利息	5,695
流動負債合計	105,401,527
負債合計	105,401,527
純資産の部	
元本等	
元本	99,685,230,468
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	209,275,561,385
元本等合計	308,960,791,853
純資産合計	308,960,791,853
負債純資産合計	309,066,193,380

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

	2022年 1月12日現在
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,685,230,468口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 3.0994円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (30,994円)</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	100,722,788,748円
期中追加設定元本額	8,518,813,088円
期中一部解約元本額	9,556,371,368円
期末元本額	99,685,230,468円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,359,406,254円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	587,200,239円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	397,686,870円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,126,889,046円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,559,039円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,055,889,863円
世界経済インデックスファンド	12,327,221,029円
DCマイセレクション25	1,914,304,480円
DCマイセレクション50	1,635,555,712円
DCマイセレクション75	1,138,307,466円
DC外国債券インデックス・オープン	2,261,500,503円
DCマイセレクションS25	908,334,505円
DCマイセレクションS50	720,368,107円
DCマイセレクションS75	393,686,027円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	33,957,402円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	88,476,999円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	44,821,688円
DC世界経済インデックスファンド	12,144,912,659円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	656,333,379円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,796,206円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,288,528円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	28,050,554円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	51,768,994円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	80,521,477円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	77,774,842円

区分	2022年 1月12日現在
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	85,922,076円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,405,317,665円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	458,367,951円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,826,513,457円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	128,983,133円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	58,059,740円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	475,243,560円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	172,815,760円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	221,575,729円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	757,627,819円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	2,053,631,937円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	722,945,345円
外国債券ファンド・シリーズ1	668,108,761円
コア投資戦略ファンド（安定型）	681,973,907円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,818,091,465円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	511,744,320円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,876,029,053円
コア投資戦略ファンド（切替型）	765,503,795円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	245,765,378円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,740,816円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,365,614,613円
SMT インデックスバランス・オープン	197,099,847円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	18,808,266,051円
SMT 世界経済インデックス・オープン	222,647,037円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	266,519,326円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	442,983,184円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,174,977円
グローバル経済コア	835,795,411円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,648,633円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,418,508円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	230,570,686円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,915,195円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	6,565,496円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	5,475,002円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,158,641円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,727,009円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	379,455,229円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,843,053,587円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	334,312,096円
外国債券インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	334,047,311円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	312,860,878円



区分	2022年 1月12日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	59,170,257円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	81,660,120円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 債券関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	5,319,145,264	-	5,236,991,689	82,153,575
	合計	5,319,145,264	-	5,236,991,689	82,153,575

（注）1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	5,294,588,860	-	5,294,520,660	68,200
	アメリカドル	2,596,619,056	-	2,596,540,236	78,820
	カナダドル	206,417,025	-	206,412,525	4,500
	ユーロ	2,153,490,864	-	2,153,507,274	16,410
	イギリスポンド	338,061,915	-	338,060,625	1,290
	合計	5,294,588,860	-	5,294,520,660	68,200

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	738,626,352
コール・ローン	630,115,262
国債証券	80,249,870,929
未収入金	180,369,836
未収利息	1,036,501,977
前払費用	168,507,196
流動資産合計	83,003,991,552
資産合計	83,003,991,552
負債の部	
流動負債	
未払金	103,880,700
未払解約金	11,904,409
未払利息	696
流動負債合計	115,785,805
負債合計	115,785,805
純資産の部	
元本等	
元本	47,173,566,586
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,714,639,161
元本等合計	82,888,205,747
純資産合計	82,888,205,747
負債純資産合計	83,003,991,552

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

2022年 1月12日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,173,566,586口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7571円 (1万口当たり純資産額) (17,571円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	40,865,028,836円
期中追加設定元本額	6,993,968,425円
期中一部解約元本額	685,430,675円
期末元本額	47,173,566,586円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,089,921,768円
世界経済インデックスファンド	10,867,249,252円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,038,636,515円
DC世界経済インデックスファンド	10,339,939,668円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,801,849,154円
コア投資戦略ファンド（安定型）	146,670,330円
コア投資戦略ファンド（成長型）	399,809,303円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	73,922,284円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	424,048,192円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	3,298,369,731円
コア投資戦略ファンド（切替型）	148,300,289円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	203,092,501円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	91,360,929円
SMT インデックスバランス・オープン	165,983,998円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,971,420,056円
SMT 世界経済インデックス・オープン	291,531,565円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	347,791,692円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	582,519,790円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,232,732円
グローバル経済コア	729,545,311円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	43,103,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	5,601,256円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	10,546,104円

区分	2022年 1月12日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	6,579,184円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	3,221,852円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	3,323,599円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	78,698,004円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	404,956,181円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	77,566,626円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	16,098,054円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	300,810,171円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	311,357,275円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	302,274,976円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	300,458,970円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	289,902,869円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	285,373,626円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,339,964,597
投資証券	106,345,480,300
未収配当金	721,609,564
前払金	22,748,000
差入委託証拠金	191,290,000
流動資産合計	110,621,092,461
資産合計	110,621,092,461
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,748,000
未払金	114,593,795
未払解約金	649,149
未払利息	3,694
流動負債合計	137,994,638
負債合計	137,994,638
純資産の部	
元本等	
元本	51,340,136,228
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,142,961,595
元本等合計	110,483,097,823

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
純資産合計	110,483,097,823
負債純資産合計	110,621,092,461

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	51,340,136,228口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.1520円 (1万口当たり純資産額) (21,520円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月12日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	49,323,843,791円
期中追加設定元本額	5,824,476,010円
期中一部解約元本額	3,808,183,573円
期末元本額	51,340,136,228円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,663,318,244円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,854,508円

区分	2022年 1月12日現在
SMT J-REITインデックス・オープン	15,902,294,276円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	24,009,371,343円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,263,376,555円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,858,973,308円
分散投資コア戦略ファンドA	720,122,850円
分散投資コア戦略ファンドS	1,541,414,897円
コア投資戦略ファンド（切替型）	791,804,026円
SMT インデックスバランス・オープン	26,560,116円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	255,743,577円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,360,999円
グローバル経済コア	237,819,335円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	10,962,246円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	441,288,869円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	59,301,346円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	480,209,438円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	16,304,525円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	527,406,533円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	74,350,626円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	878,271,875円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	265,671,600円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	302,355,136円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 投資証券関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	4,149,442,000	-	4,126,694,000	22,748,000
	合計	4,149,442,000	-	4,126,694,000	22,748,000

（注）1.時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### グローバルREITインデックス マザーファンド

#### 貸借対照表



	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	536,017,028
コール・ローン	69,836,860
投資証券	100,448,523,144
派生商品評価勘定	2,280
未収入金	4,939,519,254
未収配当金	293,270,435
流動資産合計	106,287,169,001
資産合計	106,287,169,001
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,098,208
未払金	1,275,318
未払解約金	5,197,113,003
未払利息	77
流動負債合計	5,203,486,606
負債合計	5,203,486,606
純資産の部	
元本等	
元本	39,466,464,420
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	61,617,217,975
元本等合計	101,083,682,395
純資産合計	101,083,682,395
負債純資産合計	106,287,169,001

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2022年 1月12日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,466,464,420口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.5613円 (1万口当たり純資産額) (25,613円)

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

2022年 1月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2022年 1月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	41,364,083,335円
期中追加設定元本額	4,456,095,870円
期中一部解約元本額	6,353,714,785円
期末元本額	39,466,464,420円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	61,766,844円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	97,873,344円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,688,421,461円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,841,023円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,911,777,227円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	16,749,132,560円
コア投資戦略ファンド（安定型）	709,208,254円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,597,861,481円
分散投資コア戦略ファンドA	680,511,872円
分散投資コア戦略ファンドS	1,463,074,073円
コア投資戦略ファンド（切替型）	661,940,906円
SMT インデックスバランス・オープン	139,992,472円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	214,485,652円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,416,285円
グローバル経済コア	232,545,072円

区分	2022年 1月12日現在
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	11,239,225円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	382,414,997円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	50,672,643円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,380,441,209円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	349,889,730円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	144,251,705円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	77,675,076円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	46,397,182円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	115,466,049円
SMTAM海外バランスファンド2020-05（適格機関投資家専用）	110,748,209円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	107,517,416円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	106,871,710円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	111,276,286円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	109,554,738円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	141,199,719円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	34,599,000	-	34,601,280	2,280
	アメリカドル	34,599,000	-	34,601,280	2,280
	売建	5,116,720,010	-	5,121,818,218	5,098,208
	アメリカドル	3,921,220,000	-	3,921,519,200	299,200
	カナダドル	122,952,600	-	123,888,285	935,685
	ユーロ	205,184,870	-	205,970,184	785,314
	イギリスポンド	281,932,200	-	283,119,300	1,187,100
	オーストラリアドル	348,222,000	-	349,398,000	1,176,000
	ニュージーランドドル	19,516,500	-	19,579,475	62,975
	香港ドル	57,688,800	-	57,718,830	30,030
	シンガポールドル	160,003,040	-	160,624,944	621,904
合計		5,151,319,010	-	5,156,419,498	5,095,928

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

### 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	261,688,932
コール・ローン	330,120,330
社債券	29,403,176,374
派生商品評価勘定	6,600
未収入金	626,480,743
流動資産合計	30,621,472,979
資産合計	30,621,472,979
負債の部	
流動負債	
未払金	115,916,700
未払解約金	783,750,059
未払利息	365
流動負債合計	899,667,124
負債合計	899,667,124
純資産の部	
元本等	
元本	66,318,882,449
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	36,597,076,594
元本等合計	29,721,805,855
純資産合計	29,721,805,855
負債純資産合計	30,621,472,979

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

	2022年 1月12日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。  なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,318,882,449口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 36,597,076,594円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.4482円 (4,482円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2022年 1月12日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	52,438,950,106円
期中追加設定元本額	22,004,657,907円
期中一部解約元本額	8,124,725,564円
期末元本額	66,318,882,449円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（SMA専用）	49,423,397,989円
コア投資戦略ファンド（安定型）	3,201,547,874円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,714,179,641円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,987,230,981円
SMTAMコモディティ・オープン	2,356,756,438円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	934,768,761円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	124,184,771円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	2,256,182,098円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	1,215,695,980円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	104,937,916円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	634,370,000	-	634,363,400	6,600
	アメリカドル	634,370,000	-	634,363,400	6,600
合計		634,370,000	-	634,363,400	6,600

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	29,375,477
コール・ローン	65,777,838
投資信託受益証券	28,270,717,804
派生商品評価勘定	22,125,374
流動資産合計	28,387,996,493
資産合計	28,387,996,493
負債の部	
流動負債	
未払金	2,869,350
未払解約金	6,805,569
未払利息	72
流動負債合計	9,674,991
負債合計	9,674,991
純資産の部	
元本等	
元本	22,342,212,888
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	6,036,108,614
元本等合計	28,378,321,502
純資産合計	28,378,321,502
負債純資産合計	28,387,996,493



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,342,212,888口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2702円 (1万口当たり純資産額) (12,702円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	28,562,552,203円
期中追加設定元本額	1,988,297,609円
期中一部解約元本額	8,208,636,924円
期末元本額	22,342,212,888円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,210,009,688円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,275,277,651円

区分	2022年 1月12日現在
分散投資コア戦略ファンドA	1,942,701,798円
分散投資コア戦略ファンドS	7,022,243,579円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,353,134,012円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	517,515,815円
グローバル経済コア	863,927,699円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,564,087,825円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	678,991,983円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	88,396,614円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	228,710,610円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,522,000,563円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	75,215,051円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	28,028,161,148	-	28,006,035,774	22,125,374
	アメリカドル	28,028,161,148	-	28,006,035,774	22,125,374
合計		28,028,161,148	-	28,006,035,774	22,125,374

（注）時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 米国株式LSマザーファンド

#### 貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	442,013,608
社債券	19,333,334,167
流動資産合計	19,775,347,775
資産合計	19,775,347,775
負債の部	

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	91,296,900
未払金	202,564,800
未払解約金	1,089,999
未払利息	488
流動負債合計	294,952,187
<b>負債合計</b>	294,952,187
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	19,592,461,011
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,065,423
元本等合計	19,480,395,588
<b>純資産合計</b>	19,480,395,588
<b>負債純資産合計</b>	19,775,347,775

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 1月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		19,592,461,011口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	112,065,423円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9943円 (9,943円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	18,944,877,100円
期中追加設定元本額	941,003,046円
期中一部解約元本額	293,419,135円
期末元本額	19,592,461,011円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,777,302,308円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,194,805,213円
コア投資戦略ファンド（切替型）	866,643,807円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	327,413,832円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	13,013,704,951円
米国株式LSファンド（SMA専用）	508,441,946円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	321,311,599円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	40,925,476円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	541,911,879円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2022年 1月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	19,626,046,200	-	19,717,343,100	91,296,900
	アメリカドル	19,626,046,200	-	19,717,343,100	91,296,900
	合計	19,626,046,200	-	19,717,343,100	91,296,900

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## コモディティLSアルファ・マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2022年 1月12日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	131,703,697
社債券	21,351,126,000
流動資産合計	21,482,829,697
資産合計	21,482,829,697
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,561,651
未払利息	145
流動負債合計	3,561,796
負債合計	3,561,796
純資産の部	
元本等	
元本	18,232,207,711
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,247,060,190
元本等合計	21,479,267,901
純資産合計	21,479,267,901
負債純資産合計	21,482,829,697

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,232,207,711口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.1781円 (1万口当たり純資産額) (11,781円)

（金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (その他の注記)

元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	18,197,417,712円
期中追加設定元本額	324,651,978円
期中一部解約元本額	289,861,979円
期末元本額	18,232,207,711円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,635,565,642円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,997,970,855円
コア投資戦略ファンド(切替型)	856,409,411円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	316,340,055円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	12,216,350,859円



区分	2022年 1月12日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	301,897,657円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	38,882,592円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	333,511,876円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	535,278,764円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2022年 1月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	134,785,468
社債券	19,914,293,000
流動資産合計	20,049,078,468
資産合計	20,049,078,468
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,597,522
未払利息	149
流動負債合計	1,597,671
負債合計	1,597,671
純資産の部	
元本等	
元本	23,676,450,353
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,628,969,556
元本等合計	20,047,480,797
純資産合計	20,047,480,797
負債純資産合計	20,049,078,468

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2022年 1月12日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

	2022年 1月12日現在

## （貸借対照表に関する注記）

	2022年 1月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		23,676,450,353口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	3,628,969,556円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8467円 (8,467円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 1月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 1月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月13日
期首元本額	21,125,701,112円
期中追加設定元本額	3,516,659,847円
期中一部解約元本額	965,910,606円
期末元本額	23,676,450,353円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	620,000,000円
コア投資戦略ファンド（成長型）	755,000,000円
分散投資コア戦略ファンドA	2,451,736,764円
分散投資コア戦略ファンドS	10,130,805,762円
コア投資戦略ファンド（切替型）	280,000,000円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	147,960,259円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	7,294,191,710円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	122,244,049円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	15,915,197円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（SMA専用）	249,266,249円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	198,246,469円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,411,083,894円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【コア投資戦略ファンド（安定型）】

## 【純資産額計算書】

（2022年 1月31日現在）

資産総額	46,056,575,284円
負債総額	128,731,961円
純資産総額（ - ）	45,927,843,323円
発行済口数	38,191,841,492口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2026円
（1万口当たり純資産額）	（12,026円）

## 【コア投資戦略ファンド（成長型）】

## 【純資産額計算書】

（2022年 1月31日現在）

資産総額	67,437,836,629円
負債総額	138,481,684円
純資産総額（ - ）	67,299,354,945円
発行済口数	47,547,940,037口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4154円
（1万口当たり純資産額）	（14,154円）

（参考）

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2022年 1月31日現在）

資産総額	474,015,235,461円
負債総額	448,167,802円
純資産総額（ - ）	473,567,067,659円
発行済口数	256,054,418,913口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8495円
（1万口当たり純資産額）	（18,495円）

## 日本債券ツイン戦略マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	69,533,605,069円
負債総額	660,649,603円
純資産総額（ - ）	68,872,955,466円
発行済口数	69,255,364,164口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9945円
（1万口当たり純資産額）	（9,945円）

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	508,278,869,600円
負債総額	548,211,123円
純資産総額（ - ）	507,730,658,477円
発行済口数	125,484,324,819口
1口当たり純資産額（ / ）	4.0462円
（1万口当たり純資産額）	（40,462円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	308,337,139,803円
負債総額	1,151,149,562円
純資産総額（ - ）	307,185,990,241円
発行済口数	100,297,546,224口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0627円
（1万口当たり純資産額）	（30,627円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	83,359,553,302円
負債総額	36,630,174円
純資産総額（ - ）	83,322,923,128円
発行済口数	47,578,801,365口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7513円
（1万口当たり純資産額）	（17,513円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	110,441,030,456円
負債総額	1,052,465,090円
純資産総額（ - ）	109,388,565,366円
発行済口数	52,402,096,646口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0875円
（1万口当たり純資産額）	（20,875円）

## グローバルR E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	94,830,048,936円
負債総額	148,466,394円
純資産総額（ - ）	94,681,582,542円
発行済口数	38,759,335,997口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4428円
（1万口当たり純資産額）	（24,428円）

## グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	30,712,760,567円
負債総額	282円
純資産総額（ - ）	30,712,760,285円

発行済口数	66,358,945,888口
1口当たり純資産額（ / ）	0.4628円
（1万口当たり純資産額）	（4,628円）

### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 純資産額計算書

（2022年 1月31日現在）

資産総額	27,334,786,845円
負債総額	71,565,938円
純資産総額（ - ）	27,263,220,907円
発行済口数	21,879,668,912口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2461円
（1万口当たり純資産額）	（12,461円）

### 米国株式LSマザーファンド

#### 純資産額計算書

（2022年 1月31日現在）

資産総額	20,288,878,592円
負債総額	1,581,035,407円
純資産総額（ - ）	18,707,843,185円
発行済口数	18,286,902,008口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0230円
（1万口当たり純資産額）	（10,230円）

### コモディティLSアルファ・マザーファンド

#### 純資産額計算書

（2022年 1月31日現在）

資産総額	21,203,419,045円
負債総額	150,000,454円
純資産総額（ - ）	21,053,418,591円
発行済口数	18,269,634,711口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1524円
（1万口当たり純資産額）	（11,524円）

## 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年 1月31日現在)

資産総額	17,965,489,816円
負債総額	233円
純資産総額（ - ）	17,965,489,583円
発行済口数	23,246,005,171口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7728円
（1万口当たり純資産額）	（7,728円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

## 受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとし、ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとし、

ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

## 受益権の再分割



委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

#### 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2022年 1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

#### [ D0（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2022年 4月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2022年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	14,928,919
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	70	247,727
単位型公社債投資信託	55	301,731
合計	658	15,478,377

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第36期事業年度の中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位：百万円)	
		前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		24,869	21,589
金銭の信託		5,823	10,857
前払費用		348	397
未収委託者報酬		7,284	8,471
未収運用受託報酬		5,842	6,151
未収収益		190	177
その他		4,624	3,428
流動資産合計		48,983	51,072
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	256	301
器具備品	1	576	692
その他	1	0	0
有形固定資産合計		832	993
無形固定資産			
ソフトウェア		3,030	4,104
その他		40	41
無形固定資産合計		3,070	4,145
投資その他の資産			
投資有価証券		8,469	9,950
関係会社株式		5,636	5,636
繰延税金資産		700	311
その他		35	39
投資その他の資産合計		14,842	15,937
固定資産合計		18,745	21,077
資産合計		67,729	72,149

（単位：百万円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	305	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額	587	791
金		
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

## ( 2 ) 【損益計算書】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日 )	当事業年度 ( 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日 )
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

	前事業年度	当事業年度
	（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）	（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					



剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
建物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	"	391	"
その他	4	"	4	"
計	367	"	503	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

## 4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

## 4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの

軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

#### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（\*2）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	21,589	21,589	-
(2) 金銭の信託	10,857	10,857	-
(3) 未収委託者報酬	8,471	8,471	-
(4) 未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-

(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

現金及び預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券の時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金

未払金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:百万円)

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

（有価証券関係）

#### 1. 子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

#### 2. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額0百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

##### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

##### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
	合計		5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

	種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
	合計	3,567	-	41	41

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (2) 株式関連

	種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	-	315	315
	合計	13,711	-	315	315

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。



## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

## (2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44百万円、当事業年度92百万円であります。

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

（税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

(\*1)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有 (被所有) 割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

前事業年度（2020年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2021年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

### 資産の部

#### 流動資産

現金及び預金	18,523
金銭の信託	15,986
未収委託者報酬	9,080
未収運用受託報酬	6,066

その他		5,520
流動資産合計		55,177
固定資産		
有形固定資産	1	1,024
無形固定資産		5,276
投資その他の資産		
投資有価証券		6,629
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		208
その他		37
投資その他の資産合計		12,511
固定資産合計		18,813
資産合計		73,990
負債の部		
流動負債		
未払金		8,383
未払法人税等		474
賞与引当金		302
その他	2	1,946
流動負債合計		11,106
固定負債		
退職給付引当金		781
資産除去債務		153
その他		10
固定負債合計		945
負債合計		12,051

(単位：百万円)

第36期中間会計期間末

(2021年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		39,182
利益剰余金合計		41,782
株主資本合計		61,022
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		995
繰延ヘッジ損益		78

評価・換算差額等合計	916
純資産合計	61,938
負債・純資産合計	73,990

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第36期中間会計期間		
(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)		
営業収益		
委託者報酬		20,978
運用受託報酬		5,746
その他営業収益		201
営業収益合計		26,925
営業費用		15,801
一般管理費	1	5,504
営業利益		5,620
営業外収益	2	971
営業外費用	3	1,067
経常利益		5,525
特別損失		120
税引前中間純利益		5,404
法人税、住民税及び事業税		1,663
法人税等調整額		19
法人税等合計		1,683
中間純利益		3,721

## 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

(単位：百万円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

当中間期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
中間純利益			3,721	3,721	3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	923	923	923
当中間期末残高	500	2,100	39,182	41,782	61,022

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,797
中間純利益				3,721
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	203	13	190	190
当中間期変動額合計	203	13	190	1,114
当中間期末残高	995	78	916	61,938

## 重要な会計方針

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>  子会社株式     移動平均法による原価法によっております。</p> <p>  その他有価証券     市場価格のない株式等以外のもの     時価法によっております。     （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p>  市場価格のない株式等     移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法 時価法によっております。</p> <p>3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 時価法によっております。</p> <p>4. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法</p>

によっております。

## 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

## 6. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

### (2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

## 7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

### (1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

### (2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

### (3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

### (4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

## 8. ヘッジ会計の会計処理

### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は子会社株式及び投資有価証券であります。

### (3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

### (4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

## 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。



## 10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

## （会計方針の変更）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

## 1. 「収益認識に関する会計基準」の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

## 2. 「時価の算定に関する会計基準」の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。この変更が中間財務諸表に与える影響はありません。

## （追加情報）

第36期中間会計期間

（自 2021年4月1日

至 2021年9月30日）

## 退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当中間会計期間より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、重要な会計方針 6. 引当金の計上基準（2）退職給付引当金をご参照ください。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間末

（2021年9月30日）

1 有形固定資産の減価償却累計額 591百万円

2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

## （中間損益計算書関係）

第36期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	90百万円
無形固定資産	376百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	738百万円
投資有価証券償還益	219百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,012百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2021年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない非上場株式及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)第26項に従い経過措置を適用した投資信託は、次表には含まれておりません。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先度が最も低いレベルに時価を分類しております。

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額(百万円)(*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

金銭の信託(*3)	1,051	1,296	-	2,347
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	242	(103)	-	138
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(79)	-	(79)
デリバティブ取引計	242	(183)	-	58

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)投資有価証券は当社が直接保有する投資信託であり、上記に含めておりません。当該投資有価証券の中間貸借対照表計上額は6,629百万円であります。

(\*3)金銭の信託の信託財産のうち、投資信託は上記に含めておりません。投資信託（中間貸借対照表計上額13,639百万円）も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は15,986百万円であります。

(\*4)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場有価証券は市場価格を用いて評価しております。当該有価証券は活発な市場で取引されているため、その時価をレベル1の時価に分類しております。また、金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

### デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない非上場株式の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
子会社株式	5,636

## (有価証券関係)

第36期中間会計期間末（2021年9月30日）

### 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

### 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	5,034	3,583	1,451
小計	5,034	3,583	1,451
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,595	1,611	16
小計	1,595	1,611	16
合計	6,629	5,195	1,434

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)は、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第36期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	4,614	-	98	98
	英ポンド	260	-	1	1
	カナダドル	81	-	1	1
	スイスフラン	98	-	0	0
	香港ドル	177	-	3	3
	ユーロ	497	-	1	1
合計		5,729	-	103	103

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	19,350	-	242	242
合計		19,350	-	242	242

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		4,438	-	94
	英ポンド		3,125	-	17
	カナダドル		4	-	0
	スイスフラン		78	-	0
	香港ドル		120	-	2
	ユーロ		115	-	0
	人民元		16	-	0
合計		7,900	-	79	

## （収益認識関係）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

## 3．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## （セグメント情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

## （関連情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,205百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（*）	3,454百万円

（\*）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載して  
おります。

## （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第36期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	20,646,304円65銭
1株当たり中間純利益	1,240,458円75銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）
中間純利益	3,721百万円
普通株式に係る中間純利益	3,721百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

##### (1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年4月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社北都銀行	12,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社東邦銀行	23,519	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社岩手銀行	12,089	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社横浜銀行	215,628	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社常陽銀行	85,113	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社きらぼし銀行	43,734	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社武蔵野銀行	45,743	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社南都銀行	37,924	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社群馬銀行	48,652	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社十八親和銀行	36,878	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社京都銀行	42,103	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
とうほう証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社伊予銀行	20,948	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
野村証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
きらぼしライフデザイン証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社



該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行  
設立年月日 : 2000年6月20日  
資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）  
事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。  
再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印  
業務執行社員

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（安定型）の2020年7月11日から2021年7月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（安定型）の2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年9月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（成長型）の2020年7月11日から2021年7月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（成長型）の2021年7月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2021年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。



監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年3月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（安定型）の2021年7月13日から2022年1月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（安定型）の2022年1月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月13日から2022年1月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2022年3月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（成長型）の2021年7月13日から2022年1月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（成長型）の2022年1月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年7月13日から2022年1月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。